



KLUB „Wspólny Rynek” Zarządzanie ryzykiem walutowym i stopy procentowej w mojej firmie

Data: **27 listopada 2008 r.**
Godziny: **9.30 - 15.30**
Miejsce: **Katowice ul. Jordana 18**, sala konferencyjna nr 407, Wydział Teologiczny
Uniwersytetu Śląskiego

PROGRAM

I. Zarządzanie ryzykiem walutowym

Identyfikacja i pomiar ryzyka na przykładzie wybranych firm z różnych branż
Skutki braku zarządzania ryzykiem walutowym w firmie
Korzyści dla firmy przy stosowaniu zabezpieczeń, jak zagwarantować stabilność przychodów i zysków

II. W jaki sposób zarządzać ryzykiem walutowym w firmie – praktyczne rozwiązania

Wewnętrzne metody zarządzania ryzykiem walutowym – *hedging* naturalny
Zewnętrzne metody zarządzania ryzykiem przy użyciu nowoczesnych instrumentów finansowych

- walutowy kontrakt forward – dostępne w bankach
- walutowy kontrakt futures – nowoczesne i elastyczne
- opcje walutowe – efektywny sposób zabezpieczenia ryzyka
- strategie opcyjne – zerokosztowe zabezpieczenie kursu wymiany waluty

III. Strategie zabezpieczające przed ryzykiem walutowym w przykładach

Przykłady strategii zabezpieczających dla eksporterów i importerów
Przykłady korytarzy opcyjnych – zerokosztowych zabezpieczeń kursu walutowego
Zabezpieczenie przed ryzykiem walutowym rocznego planu finansowego firmy
Ocena obecnej sytuacji na rynku walutowym – kiedy się zabezpieczać
Przykłady strategii zabezpieczających przed wzrostem stopy procentowej

IV. Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej

Identyfikacja i pomiar ryzyka stopy procentowej
Korzyści dla firmy przy stosowaniu zabezpieczeń, jak kontrolować koszt kredytu
Przykłady strategii zabezpieczających przed ryzykiem stopy procentowej

V. Dokonywanie transakcji na rynku międzybankowym

Specyfika obrotu instrumentami giełdowymi
Korzyści z dokonywania transakcji na rynku międzybankowym – na przykładzie transakcji dokonywanych na Warszawskiej Giełdzie Towarowej S.A.