VIII конференция «Ипотечные ценные бумаги и секьюритизация в России»

19 сентября 2019 г.
Москва
Кортъярд Марриотт Москва Центр (Вознесенский пер., д. 7)

Программа

День 1 (19.09.2019)

12:00 - 12:30 Регистрация участников, приветственный кофе

12:30 - 12:40 Приветственные слова организаторов

Сергей Лялин, генеральный директор, Группа компаний Cbonds

12:40 - 14:10 Рынок секьюритизации в России: текущее состояние и перспективы развития

Модератор: **Андрей Сучков**, управляющий директор, начальник управления секьюритизации, ВТБ Капитал

Андрей Сучков, управляющий директор, начальник управления секьюритизации, ВТБ Капитал

Александра Веролайнен, управляющий директор по рейтингам структурированного финансирования, Эксперт РА

Игорь Зелезецкий, генеральный директор, АКРА

Кирилл Гришанов, управляющий директор, ДОМ.РФ

Виктор Киселев, руководитель управления структурированных продуктов и секьюритизации, Тинькофф Банк

Вопросы для обсуждения:
Вопросы для обсуждения:

1. *Характеристики рынка секьюритизации в 2019 году*
2. *Структура инвесторов в ИЦБ: как повысить ликвидность облигаций?*
3. *Регулирование рынка: что еще нужно для комфортной регуляторной среды?*
4. *Стоит ли ждать многотраншевые сделки или на рынке останутся только выпуски ДОМ.РФ?*
5. *Неипотечные сделки: какие активы можно секьюритизировать и когда ожидаем новые сделки?*

14:10 - 14:40 Ланч-брейк

14:40 - 16:00 Оценка и анализ ипотечных ценных бумаг

Модератор: **Дмитрий Дорофеев**, старший менеджер, управление секьюритизации, ВТБ Капитал

Дмитрий Дорофеев, старший менеджер, управление секьюритизации, ВТБ Капитал

Андрей Камышев, директор ценового центра, ДОМ.РФ

Глеб Шевеленков, директор департамента долгового рынка, Московская Биржа

Равиль Юсипов, заместитель генерального директора, руководитель управления фондовых операций, УК ТФГ

Павел Колосов, руководитель экспертной группы, аналитическое управление, департамент коллективных инвестиций и доверительного управления, Банк России

Андрей Буш, руководитель управления инвестиционно-банковских услуг, ИФК Солид

Вопросы для обсуждения:
Вопросы для обсуждения:

1. *Вторичный рынок ИЦБ – ликвидность, индекс ИЦБ, маркет-мейкинг*
2. *Существующие подходы и модели иценки ИЦБ: плюсы и минусы*
3. *Модели досрочных погашений: основные факторы влияющие на CPR; существующий калькулятор на Bloomberg – плюсы и минусы*
4. *Сложности сбора первичных данных и интерпретации эмиссионной документации – как упростить процесс получения информации*
5. *Оценка ИЦБ в соответствии с МСФО 13; конвенция по CPR/CDR для целей расчета YTM в стакане биржи и модели НРД. Почему бы не использовать CPR=10, CDR = 1 как дефолтные вводные показатели для расчетов?*
6. *Новые группы клиентов – страховые компании, частные инвесторы, иностранные инвесторы.*

16:00 - 16:30 Кофе-брейк

16:30 - 18:00 Обзор практики секьюритизации в России. Правовые аспекты сопровождения сделок

Модератор: **Олег Иванов**, советник председателя совета, со-председатель комитета по инвестиционным банковским продуктам, Ассоциация банков России

Сергей Кадук, исполнительный директор, секьюритизация и проектное финансирование, Совкомбанк

Никита Борзов, эксперт группы рейтингов структурированных финансовых инструментов, АКРА

Олег Иванов, советник председателя совета, со-председатель комитета по инвестиционным банковским продуктам, Ассоциация банков России

Денис Гришухин, главный исполнительный директор, департамент структурного финансирования, МСП Банк

Константин Потапов, руководитель юридического отдела, ТМФ РУС

Елизавета Турбина, партнер, LECAP

18:00 Фуршет, деловое общение