

Julio Cesar Cubillas Rodriguez

DNI 46767877

Jr. Tacna 1085 departamento 1506 – Magdalena del Mar

Celular: 993902393

Email: jcubillas09@gmail.com

Educación

CFA INSTITUTE

He aprobado el nivel II del CFA Program

He culminado la certificación CIPM

Universidad Nacional de Ingeniería (Mar. 2009 – Ago. 2014)**Bachiller en Ciencias con Mención en Ingeniería Económica – Décimo superior****Universidad Nacional de Ingeniería (Mar. 2014 – Ago. 2014)****XII Diplomado en Finanzas – Décimo superior****Experiencia Docente**

Profesor de los cursos: Taller de Derivados y Performance Attribution – UNI (2017)

Profesor de Economía en Taller de Preparación para el CFA 1 – GIDDEA (2018)

Profesor en Teoría de Portafolio en el Programa de Finanzas – Lambda (2019)

Experiencia Laboral

BBVA Asset Management (Nov. 2019 – Actual)**Portfolio Manager & Credit Analyst – BBVA Asset Management**

- A cargo de la gestión de portafolios de Money Market, Renta Variable y Mixtos, así como encargado de la gestión portafolios de Mediano Plazo de Renta Fija en los sectores de responsabilidad y Deuda Soberana Latinoamericana en Dólares estadounidenses.
- Encargado del análisis crediticio, reporte y seguimiento de Emisores de los sectores Utilities (Perú y Chile)
- Encargado del análisis relativo y de sentimiento de instrumentos de gobierno en dólares de países latinoamericanos, así como a nivel sectorial de emisores corporativos en Latinoamérica.
- Desarrollé herramientas en Python para el análisis de valor y sentimiento de deuda Soberana Latinoamericana y emisores Corporativos a nivel de todos los sectores.

BBVA Continental (Ago. 2018 – Nov 2019)**Multi-Asset Portfolio Manager – Administración de Patrimonios**

- Gestión directa de los componentes de Money Market, Renta Fija y Renta Variable de los portafolios discretos de los clientes naturales e institucionales del Banco.
- Presentación de propuestas de valor, portafolios modelos y resultados a clientes existentes y potenciales de la Banca Privada e institucional.
- Encargado del análisis crediticio de Emisores de los sectores Utilities, Telecomunicaciones y Transporte.
- Encargado del análisis relativo y momentum de instrumentos de gobierno en dólares de países latinoamericanos.

BBVA Asset Management Continental SAF (Mar. 2017 – Jul. 2018)**Analista Senior de Riesgos Financieros – Fondos Mutuos BBVA**

- Encargado de los procesos relacionados a valorización, métricas de performance attribution y performance appraisal.
- Análisis y seguimiento crediticio de empresas del sector real y financiero.
- Encargado de la medición, control y reporte de la gestión de riesgos financieros (mercado, crédito y liquidez) y cumplimiento normativo.

BBVA Asset Management Continental SAF (Jun. 2015 – Feb. 2017)**Analista de Riesgos Financieros – Fondos Mutuos BBVA**

- Reportar sobre el estado y variaciones sobre posición de derivados, riesgo de liquidez, riesgo de mercado, riesgo de crédito y cumplimiento normativo.
- Cálculo de métricas de riesgo de mercado y performance: Value at Risk, Backtesting, Tracking Error, Benchmark VaR, VaR maginal, Liquidity Adjusted VaR, escenarios de estrés, etc.

Banco de Crédito BCP (Sep. 2014 – May. 2015)**Analista de Riesgos Banco Persona – División de Banca Minorista**

- Realizar análisis y propuestas en materia de gestión temprana de riesgo de crédito, según sectores económicos y zona geográfica, así como otras agregaciones del giro de negocio.
- Análisis de correlación y modelamiento econométrico de variables económicas y sectoriales con aquellas relacionadas a las carteras de banca minorista del banco (stock de provisiones, gasto de provisiones, morosidad)

INFORMACIÓN ADICIONAL

- Idiomas: Inglés (avanzado), Software: Bloomberg, VBA y MS Excel (avanzado), EViews, Python.