

Índice

Introducción	8
1 Introducción: Conceptos clave para la gestión de carteras de renta fija.	12
2 Gestión activa de la duración: un modelo cuantitativo.	40
3 Estrategias semi-activas de gestión: <i>Carry</i> , <i>Roll-down</i> y <i>Rolling Yield</i> .	66
4 Estrategias sobre la curva de rendimientos (I): Pendientes y <i>switches</i> intra-curva.	98
5 Estrategias sobre la curva de rendimientos (II): <i>Butterfly trades</i> .	132
6 Gestión de carteras de crédito (I): Aspectos clave.	166
7 Gestión de carteras de crédito (II): El binomio tipos- <i>spreads</i> .	198
8 Gestión de carteras de crédito (III): Estrategias con <i>Credit Default Swaps</i> .	216
9 Atribución de resultados en una cartera de bonos: la perspectiva del gestor de carteras.	244
Bibliografía	276