Descargar
Tenga en cuenta

La Constitución Política de Colombia y el artículo 14 de la Ley 31 de 1992 asignan al Banco de la República la función de administrar las reservas internacionales. Las opiniones y posibles errores son responsabilidad exclusiva del autor y sus contenidos no comprometen al Banco de la República ni a su Junta Directiva.

Autor o Editor
Departamento de Reservas Internacionales
Fecha de publicación
Martes, 24 de diciembre de 2019

El riesgo de mercado de un portafolio se materializa cuando los precios de los activos que lo componen disminuyen. En el caso de un portafolio de renta fija, como el de las reservas internacionales, esto ocurre cuando aumentan las tasas de interés de los mercados en los cuales se transan estos activos. Con el fin de controlar este riesgo en el portafolio de las reservas internacionales, se establecen restricciones en el proceso de optimización y construcción de los índices de referencia sobre algunas medidas de riesgo de mercado.