

Anexo 3

Cálculo del Índice de Actividad en Udibonos (IAU)

El Índice de Actividad en UDIBONOS (IAU) de los Formadores de Mercado se calcula con base en las posturas computables que éstos presentan en las Subastas de UDIBONOS, como se definen en el numeral 5.7.1 ii) de este Oficio. De esta forma, el IAU se define como:

$$IAU(T)^j = \sum_i PC(T)_i^j$$

Donde:

$IAU(T)^j$ IAU del Formador de Mercado j durante el periodo de medición T .

$PC(T)_i^j$ Monto nominal en UDIS de cada postura computable i en la subasta primaria de UDIBONOS, definida en el numeral 5.7.1 ii) de este Oficio, que sea concertada durante el periodo de medición T .

T Periodo de medición definido en el numeral 5.3 de este Oficio. De esta forma, cada periodo de medición incluirá las posturas computables de las Subastas de UDIBONOS concertadas entre el día 16 del mismo mes del año anterior al mes de medición y el día 15 del mes de medición.