

MERCADO DE DIVISAS DE MADRID
Volumen medio diario de negociación
(En millones de dólares USA)

CUADRO 1 - SEGMENTOS DE MERCADO

| SEGMENTOS | 2001 | | 1998 | | 01/98 |
|-----------|---------|-----|---------|-----|-------|
| | Importe | % | Importe | % | % |
| TOTAL | 7.579 | 100 | 19.318 | 100 | -61 |
| Contado | 2.670 | 35 | 6.248 | 32 | -57 |
| Plazo | 763 | 10 | 1.042 | 6 | -27 |
| Swap | 4.146 | 55 | 12.028 | 62 | -66 |

CUADRO 2 - MONEDAS CONTRATADAS

| MONEDAS | 2001 | | | |
|-----------|---------|-----------|---------|--------|
| | TOTAL % | CONTADO % | PLAZO % | SWAP % |
| Euro | 87 | 83 | 92 | 89 |
| Dólar USA | 91 | 81 | 87 | 99 |
| Otras | 22 | 36 | 21 | 12 |

CUADRO 3 - TOTAL MERCADO: POR PARES DE MONEDAS

| PARES DE MONEDAS | 2001 | | 1998 | | 01/98 |
|------------------|---------|-----|---------|-----|-------|
| | Importe | % | Importe | % | % |
| TOTAL | 7.579 | 100 | 19.318 | 100 | -61 |
| Euro/Dólar USA | 5.924 | 78 | 15.647 | 81 | -62 |
| Euro/Resto | 659 | 9 | 655 | 3 | -- |
| Dólar USA/Resto | 996 | 13 | 1.006 | 5 | -- |
| Euro/Euro | -- | -- | 2.010 | 11 | -100 |

CUADRO 4 - CONTADO: POR PARES DE MONEDAS

| PARES DE MONEDAS | 2001 | | 1998 | | 01/98 |
|------------------|---------|-----|---------|-----|-------|
| | Importe | % | Importe | % | % |
| TOTAL | 2.670 | 100 | 6.248 | 100 | -57 |
| Euro/Dólar USA | 1.695 | 64 | 3.578 | 57 | -53 |
| Euro/Resto | 520 | 19 | 570 | 9 | -9 |
| Dólar USA/Resto | 455 | 17 | 315 | 5 | 44 |
| Euro/Euro | -- | 0 | 1.785 | 29 | -100 |

CUADRO 5 - PLAZO: POR PARES DE MONEDAS

| PARES MONEDAS | 2001 | | 1998 | | 01/98 |
|-----------------|---------|-----|---------|-----|-------|
| | Importe | % | Importe | % | % |
| TOTAL | 763 | 100 | 1.042 | 100 | -27 |
| Euro/Dólar USA | 603 | 79 | 824 | 79 | -27 |
| Euro/Resto | 101 | 13 | 48 | 5 | 110 |
| Dólar USA/Resto | 59 | 8 | 45 | 4 | 31 |
| Euro/Euro | -- | -- | 125 | 12 | -100 |

CUADRO 6 - SWAP: POR PARES DE MONEDAS

| PARES DE MONEDAS | 2001 | | 1998 | | 01/98 |
|------------------|---------|-----|---------|-----|-------|
| | Importe | % | Importe | % | % |
| TOTAL | 4.146 | 100 | 12.028 | 100 | -66 |
| Euro/Dólar USA | 3.628 | 88 | 11.245 | 94 | -68 |
| Euro/Resto | 38 | 1 | 37 | 0 | 3 |
| Dólar USA/Resto | 480 | 11 | 646 | 5 | -26 |
| Euro/Euro | -- | -- | 100 | 1 | 100 |

CUADRO 7 - TOTAL MERCADO: POR CONTRAPARTIDAS

| CONTRAPARTIDAS | 2001 | | 1998 | | 01/98 |
|-------------------------------|-------|-----|--------|-----|-------|
| TOTAL | 7.579 | 100 | 19.318 | 100 | -61 |
| Entidades de cto. informantes | 3.269 | 43 | 16.517 | 86 | -80 |
| - Españolas | 188 | 2 | 2.427 | 13 | -92 |
| - Extranjeras | 3.081 | 41 | 14.090 | 73 | -78 |
| Con otras instit. financ. | 3.438 | 45 | 1.614 | 8 | 113 |
| - Españolas | 432 | 6 | 778 | 4 | -44 |
| - Extranjeras | 3.006 | 39 | 836 | 4 | 260 |
| Con clientes no financieros | 872 | 12 | 1.188 | 6 | -27 |
| - Españoles | 789 | 11 | 995 | 5 | -21 |
| - Extranjeros | 83 | 1 | 193 | 1 | -57 |

CUADRO 8 - SWAP: POR VENCIMIENTOS

| VENCIMIENTOS | 2001 | 1998 |
|-----------------------------------|------|------|
| | % | % |
| TOTAL | 100 | 100 |
| Hasta siete días | 66 | 72 |
| De más de siete días hasta un año | 33 | 26 |
| Más de un año | 1 | 2 |