

2016年中国外汇市场交易概况

单位：亿元人民币

交易品种	2016年1月	2016年2月	2016年3月	2016年4月	2016年5月	2016年6月	2016年7月	2016年8月	2016年9月	2016年10月	2016年11月	2016年12月	合计
一、即期	49690	29778	45959	43159	43738	48394	48135	49205					358058
银行对客户市场	19802	12961	15876	14528	15526	16656	15269	15871					126489
其中：买入外汇	11487	7394	8940	7710	7917	8543	8574	8174					68738
卖出外汇	8315	5567	6936	6818	7609	8113	6695	7697					57751
银行间外汇市场	29888	16817	30083	28631	28212	31738	32867	33334					231570
二、远期	2559	1030	1337	998	1811	2239	2403	1961					14338
银行对客户市场	2100	848	1153	823	995	1163	1126	943					9151
其中：买入外汇	1861	623	753	452	454	609	830	533					6115
卖出外汇	239	225	400	371	540	554	296	410					3036
其中：3个月（含）以下	864	334	638	443	481	568	489	368					4185
3个月至1年（含）	1082	458	439	344	378	525	527	571					4324
1年以上	154	55	76	36	136	71	110	5					642
银行间外汇市场	459	182	185	175	816	1076	1278	1018					5188
其中：3个月（含）以下	228	83	108	118	698	935	1203	971					4343
3个月至1年（含）	194	98	58	47	106	130	72	45					751
1年以上	37	1	19	10	12	10	2	2					93
三、外汇和货币掉期	48588	32738	56475	51272	52506	51609	55329	59375					407891
银行对客户市场	987	342	617	570	497	526	425	409					4373
其中：近端换入外汇	778	169	211	209	129	95	58	122					1771
近端换出外汇	208	173	406	361	368	431	367	287					2601
银行间外汇市场	47602	32396	55858	50702	52009	51083	54904	58966					403519
其中：3个月（含）以下	42008	28485	49231	45703	45877	45592	48301	53253					358450
3个月至1年（含）	5514	3870	6554	4950	6027	5422	6520	5677					44533
1年以上	80	41	73	49	105	69	83	37					536
四、期权	3086	1992	3377	2460	3406	3177	5031	7901					30429
银行对客户市场	1600	529	982	679	661	1052	930	1472					7906
其中：买入期权	790	224	442	297	276	538	477	746					3789
卖出期权	809	306	539	383	386	513	453	727					4116
其中：3个月（含）以下	824	219	437	244	232	327	273	394					2950
3个月至1年（含）	656	280	476	337	326	593	487	917					4073
1年以上	119	31	68	98	102	132	170	162					882
银行间外汇市场	1486	1463	2395	1781	2745	2125	4101	6428					22524
其中：3个月（含）以下	1093	1309	2114	1636	2552	1943	3839	6259					20744
3个月至1年（含）	392	154	279	145	192	182	254	166					1764
1年以上	2	0	2	0	0	0	8	4					15
五、合计	103923	65537	107148	97889	101461	105418	110899	118441					810717
其中：银行对客户市场	24489	14680	18628	16601	17679	19398	17750	18695					147918
银行间外汇市场	79435	50857	88521	81289	83782	86021	93149	99746					662799
其中：即期	49690	29778	45959	43159	43738	48394	48135	49205					358058
远期	2559	1030	1337	998	1811	2239	2403	1961					14338
外汇和货币掉期	48588	32738	56475	51272	52506	51609	55329	59375					407891
期权	3086	1992	3377	2460	3406	3177	5031	7901					30429

注：1、外汇市场统计口径仅限于人民币对外汇交易，不含外汇之间交易。

2、银行对客户市场采用客户买卖外汇总额，银行间外汇市场采用单边交易量，均为发生额本金。

3、银行对客户市场的即期=买入外汇（售汇）+卖出外汇（结汇）（含银行自身结售汇，不含远期结售汇履约）、远期=买入外汇（售汇）+卖出外汇（结汇）、外汇和货币掉期=近端换入外汇（售汇）+近端换出外汇（结汇）、期权=买入期权+卖出期权，均采用客户交易方向。

4、外汇市场交易数据按美元编制，当月人民币计价数据由美元数据按月均人民币对美元汇率中间价折算得到。

5、本表计数采用四舍五入原则。