

2015年中国外汇市场交易概况

单位：亿美元

交易品种	2015年1月	2015年2月	2015年3月	2015年4月	2015年5月	2015年6月	2015年7月	2015年8月	2015年9月	2015年10月	2015年11月	2015年12月	合计
一、即期	6077	4765	8498	6179	5303	5484	6980						43286
银行对客户市场	2841	2181	2750	2627	2469	2808	2873						18549
其中：买入外汇	1459	1159	1636	1372	1240	1402	1639						9906
卖出外汇	1382	1022	1114	1255	1229	1406	1234						8643
银行间外汇市场	3236	2583	5748	3552	2834	2676	4107						24737
二、远期	487	367	523	393	416	498	511						3194
银行对客户市场	455	339	497	365	392	463	478						2989
其中：买入外汇	257	246	378	217	227	274	319						1917
卖出外汇	198	93	120	148	165	189	159						1072
其中：3个月（含）以下	265	191	303	167	202	247	270						1644
3个月至1年（含）	133	105	142	156	154	171	155						1016
1年以上	57	42	52	42	36	45	54						329
银行间外汇市场	32	28	25	29	24	35	32						205
其中：3个月（含）以下	24	24	16	21	17	24	25						150
3个月至1年（含）	8	3	8	7	6	8	7						48
1年以上	0	1	1	1	1	3	1						7
三、外汇和货币掉期	4646	3226	5870	6095	6226	6640	8800						41502
银行对客户市场	375	254	455	222	135	204	238						1883
其中：近端换入外汇	342	239	431	197	104	177	231						1721
近端换出外汇	33	15	25	25	31	27	6						162
银行间外汇市场	4271	2973	5415	5873	6090	6436	8562						39619
其中：3个月（含）以下	3679	2613	4753	5215	5476	5958	7934						35628
3个月至1年（含）	581	351	642	632	601	474	620						3901
1年以上	11	8	20	25	14	5	8						90
四、期权	347	257	338	282	290	344	487						2344
银行对客户市场	131	85	130	103	90	111	121						771
其中：买入期权	69	44	67	55	51	70	72						426
卖出期权	62	41	63	48	39	42	49						345
其中：3个月（含）以下	45	37	55	51	33	55	53						329
3个月至1年（含）	62	29	48	36	43	39	47						305
1年以上	24	18	27	17	14	17	20						138
银行间外汇市场	216	172	208	179	200	232	366						1573
其中：3个月（含）以下	147	144	161	138	165	204	315						1273
3个月至1年（含）	68	28	47	41	36	29	51						299
1年以上	1	0	0	0	0	0	0						1
五、合计	11556	8615	15229	12949	12235	12965	16777						90326
其中：银行对客户市场	3802	2859	3833	3316	3087	3586	3710						24192
银行间外汇市场	7754	5756	11397	9632	9148	9379	13068						66134
其中：即期	6077	4765	8498	6179	5303	5484	6980						43286
远期	487	367	523	393	416	498	511						3194
外汇和货币掉期	4646	3226	5870	6095	6226	6640	8800						41502
期权	347	257	338	282	290	344	487						2344

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、本表计数采用四舍五入原则。