

2016年中国外汇市场交易概况

单位：亿美元

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	7583	4559	7064										19206
银行对客户市场	3022	1985	2440										7447
其中：买入外汇	1753	1132	1374										4259
卖出外汇	1269	852	1066										3187
银行间外汇市场	4561	2575	4624										11760
二、远期	391	158	206										754
银行对客户市场	320	130	177										627
其中：买入外汇	284	95	116										495
卖出外汇	37	34	61										132
其中：3个月（含）以下	132	51	98										281
3个月至1年（含）	165	70	67										303
1年以上	24	8	12										44
银行间外汇市场	70	28	28										126
其中：3个月（含）以下	35	13	17										64
3个月至1年（含）	30	15	9										54
1年以上	6	0	3										9
三、外汇和货币掉期	7415	5013	8680										21108
银行对客户市场	151	52	95										298
其中：近端换入外汇	119	26	32										177
近端换出外汇	32	26	62										121
银行间外汇市场	7264	4960	8585										20810
其中：3个月（含）以下	6411	4361	7567										18339
3个月至1年（含）	841	592	1007										2441
1年以上	12	6	11										30
四、期权	471	305	519										1295
银行对客户市场	244	81	151										476
其中：买入期权	121	34	68										223
卖出期权	124	47	83										253
其中：3个月（含）以下	126	33	67										227
3个月至1年（含）	100	43	73										216
1年以上	18	5	11										33
银行间外汇市场	227	224	368										819
其中：3个月（含）以下	167	200	325										692
3个月至1年（含）	60	24	43										126
1年以上	0	0	0										1
五、合计	15860	10035	16468										42362
其中：银行对客户市场	3737	2248	2863										8848
银行间外汇市场	12122	7787	13605										33514
其中：即期	7583	4559	7064										19206
远期	391	158	206										754
外汇和货币掉期	7415	5013	8680										21108
期权	471	305	519										1295

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。