

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							260718
银行对客户市场	19802	12961	15876	14528	15526	16656							95349
其中：买入外汇	11487	7394	8940	7710	7917	8543							51990
卖出外汇	8315	5567	6936	6818	7609	8113							43359
银行间外汇市场	29888	16817	30083	28631	28212	31738							165369
二、远期	2559	1030	1337	998	1811	2239							9974
银行对客户市场	2100	848	1153	823	995	1163							7082
其中：买入外汇	1861	623	753	452	454	609							4752
卖出外汇	239	225	400	371	540	554							2330
其中：3个月（含）以下	864	334	638	443	481	568							3328
3个月至1年（含）	1082	458	439	344	378	525							3227
1年以上	154	55	76	36	136	71							527
银行间外汇市场	459	182	185	175	816	1076							2892
其中：3个月（含）以下	228	83	108	118	698	935							2169
3个月至1年（含）	194	98	58	47	106	130							634
1年以上	37	1	19	10	12	10							89
三、外汇和货币掉期	48588	32738	56475	51272	52506	51609							293187
银行对客户市场	987	342	617	570	497	526							3539
其中：近端换入外汇	778	169	211	209	129	95							1591
近端换出外汇	208	173	406	361	368	431							1947
银行间外汇市场	47602	32396	55858	50702	52009	51083							289649
其中：3个月（含）以下	42008	28485	49231	45703	45877	45592							256896
3个月至1年（含）	5514	3870	6554	4950	6027	5422							32336
1年以上	80	41	73	49	105	69							416
四、期权	3086	1992	3377	2460	3406	3177							17498
银行对客户市场	1600	529	982	679	661	1052							5503
其中：买入期权	790	224	442	297	276	538							2567
卖出期权	809	306	539	383	386	513							2936
其中：3个月（含）以下	824	219	437	244	232	327							2284
3个月至1年（含）	656	280	476	337	326	593							2669
1年以上	119	31	68	98	102	132							550
银行间外汇市场	1486	1463	2395	1781	2745	2125							11994
其中：3个月（含）以下	1093	1309	2114	1636	2552	1943							10647
3个月至1年（含）	392	154	279	145	192	182							1344
1年以上	2	0	2	0	0	0							4
五、合计	103923	65537	107148	97889	101461	105418							581377
其中：银行对客户市场	24489	14680	18628	16601	17679	19398							111473
银行间外汇市场	79435	50857	88521	81289	83782	86021							469904
其中：即期	49690	29778	45959	43159	43738	48394							260718
远期	2559	1030	1337	998	1811	2239							9974
外汇和货币掉期	48588	32738	56475	51272	52506	51609							293187
期权	3086	1992	3377	2460	3406	3177							17498

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。