

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										125426
银行对客户市场	19802	12961	15876										48639
其中：买入外汇	11487	7394	8940										27820
卖出外汇	8315	5567	6936										20819
银行间外汇市场	29888	16817	30083										76788
二、远期	2559	1030	1337										4926
银行对客户市场	2100	848	1153										4101
其中：买入外汇	1861	623	753										3237
卖出外汇	239	225	400										864
其中：3个月（含）以下	864	334	638										1836
3个月至1年（含）	1082	458	439										1980
1年以上	154	55	76										285
银行间外汇市场	459	182	185										825
其中：3个月（含）以下	228	83	108										418
3个月至1年（含）	194	98	58										351
1年以上	37	1	19										57
三、外汇和货币掉期	48588	32738	56475										137801
银行对客户市场	987	342	617										1946
其中：近端换入外汇	778	169	211										1159
近端换出外汇	208	173	406										787
银行间外汇市场	47602	32396	55858										135855
其中：3个月（含）以下	42008	28485	49231										119724
3个月至1年（含）	5514	3870	6554										15937
1年以上	80	41	73										193
四、期权	3086	1992	3377										8455
银行对客户市场	1600	529	982										3111
其中：买入期权	790	224	442										1456
卖出期权	809	306	539										1655
其中：3个月（含）以下	824	219	437										1481
3个月至1年（含）	656	280	476										1412
1年以上	119	31	68										218
银行间外汇市场	1486	1463	2395										5344
其中：3个月（含）以下	1093	1309	2114										4516
3个月至1年（含）	392	154	279										825
1年以上	2	0	2										4
五、合计	103923	65537	107148										276609
其中：银行对客户市场	24489	14680	18628										57796
银行间外汇市场	79435	50857	88521										218812
其中：即期	49690	29778	45959										125426
远期	2559	1030	1337										4926
外汇和货币掉期	48588	32738	56475										137801
期权	3086	1992	3377										8455

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。