

## 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
<b>一、即期</b>	<b>7583</b>	<b>4559</b>	<b>7064</b>	<b>6664</b>	<b>6697</b>	<b>7346</b>	<b>7209</b>	<b>7402</b>					<b>54524</b>
<b>银行对客户市场</b>	<b>3022</b>	<b>1985</b>	<b>2440</b>	<b>2243</b>	<b>2377</b>	<b>2528</b>	<b>2287</b>	<b>2387</b>					<b>19270</b>
其中：买入外汇	1753	1132	1374	1191	1212	1297	1284	1230					10472
卖出外汇	1269	852	1066	1053	1165	1232	1003	1158					8797
<b>银行间外汇市场</b>	<b>4561</b>	<b>2575</b>	<b>4624</b>	<b>4421</b>	<b>4319</b>	<b>4818</b>	<b>4922</b>	<b>5015</b>					<b>35255</b>
<b>二、远期</b>	<b>391</b>	<b>158</b>	<b>206</b>	<b>154</b>	<b>277</b>	<b>340</b>	<b>360</b>	<b>295</b>					<b>2180</b>
<b>银行对客户市场</b>	<b>320</b>	<b>130</b>	<b>177</b>	<b>127</b>	<b>152</b>	<b>177</b>	<b>169</b>	<b>142</b>					<b>1394</b>
其中：买入外汇	284	95	116	70	70	92	124	80					931
卖出外汇	37	34	61	57	83	84	44	62					463
其中：3个月（含）以下	132	51	98	68	74	86	73	55					638
3个月至1年（含）	165	70	67	53	58	80	79	86					658
1年以上	24	8	12	5	21	11	16	1					98
<b>银行间外汇市场</b>	<b>70</b>	<b>28</b>	<b>28</b>	<b>27</b>	<b>125</b>	<b>163</b>	<b>191</b>	<b>153</b>					<b>786</b>
其中：3个月（含）以下	35	13	17	18	107	142	180	146					657
3个月至1年（含）	30	15	9	7	16	20	11	7					114
1年以上	6	0	3	2	2	2	0	0					14
<b>三、外汇和货币掉期</b>	<b>7415</b>	<b>5013</b>	<b>8680</b>	<b>7917</b>	<b>8039</b>	<b>7834</b>	<b>8286</b>	<b>8932</b>					<b>62116</b>
<b>银行对客户市场</b>	<b>151</b>	<b>52</b>	<b>95</b>	<b>88</b>	<b>76</b>	<b>80</b>	<b>64</b>	<b>62</b>					<b>667</b>
其中：近端换入外汇	119	26	32	32	20	14	9	18					271
近端换出外汇	32	26	62	56	56	65	55	43					396
<b>银行间外汇市场</b>	<b>7264</b>	<b>4960</b>	<b>8585</b>	<b>7829</b>	<b>7963</b>	<b>7755</b>	<b>8222</b>	<b>8871</b>					<b>61449</b>
其中：3个月（含）以下	6411	4361	7567	7057	7024	6921	7233	8011					54585
3个月至1年（含）	841	592	1007	764	923	823	976	854					6782
1年以上	12	6	11	8	16	10	12	5					82
<b>四、期权</b>	<b>471</b>	<b>305</b>	<b>519</b>	<b>380</b>	<b>521</b>	<b>482</b>	<b>753</b>	<b>1189</b>					<b>4620</b>
<b>银行对客户市场</b>	<b>244</b>	<b>81</b>	<b>151</b>	<b>105</b>	<b>101</b>	<b>160</b>	<b>139</b>	<b>221</b>					<b>1203</b>
其中：买入期权	121	34	68	46	42	82	71	112					576
卖出期权	124	47	83	59	59	78	68	109					627
其中：3个月（含）以下	126	33	67	38	36	50	41	59					449
3个月至1年（含）	100	43	73	52	50	90	73	138					619
1年以上	18	5	11	15	16	20	25	24					134
<b>银行间外汇市场</b>	<b>227</b>	<b>224</b>	<b>368</b>	<b>275</b>	<b>420</b>	<b>323</b>	<b>614</b>	<b>967</b>					<b>3418</b>
其中：3个月（含）以下	167	200	325	253	391	295	575	942					3147
3个月至1年（含）	60	24	43	22	29	28	38	25					269
1年以上	0.2	0	0.3	0	0	0	1	1					2
<b>五、合计</b>	<b>15860</b>	<b>10035</b>	<b>16468</b>	<b>15115</b>	<b>15534</b>	<b>16003</b>	<b>16608</b>	<b>17818</b>					<b>123440</b>
其中：银行对客户市场	3737	2248	2863	2563	2707	2945	2658	2812					22533
银行间外汇市场	12122	7787	13605	12552	12827	13058	13950	15005					100907
其中：即期	7583	4559	7064	6664	6697	7346	7209	7402					54524
远期	391	158	206	154	277	340	360	295					2180
外汇和货币掉期	7415	5013	8680	7917	8039	7834	8286	8932					62116
期权	471	305	519	380	521	482	753	1189					4620

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。