

보도	2023.6.16.(금) 조간	배포	2023.6.15.(목)		
담당부서	자본시장감독국 파생거래감독팀	책임자	팀 장	안태훈	(02-3145-7600)
		담당자	선 임	이정민	(02-3145-7602)

2022년 금융회사 장외파생상품 거래현황

I. 장외파생상품 총 거래규모 및 잔액

- ◆ (거래규모) 국내 금융회사의 **장외파생상품 거래규모**는 **총 2경 4,548조원**으로 **통화선도** 관련 거래가 1경 5,754조원(64.2%)으로 가장 큰 비중이며 **이자율스왑** 관련 7,133조원(29.1%), **통화스왑** 관련 1,216조원(5.0%) 등 順
- ◆ (거래잔액) 국내 금융회사의 **장외파생상품 거래잔액**은 **총 1경 2,210조원**으로 **이자율스왑** 관련 거래가 7,360조원(60.3%)으로 가장 큰 비중이며 **통화선도** 관련 2,704조원(22.1%), **통화스왑** 관련 1,701조원(13.9%) 등 順

- (거래규모) '22년 중 국내 금융회사의 장외파생상품 거래규모*는 총 2경 4,548조원으로 전년(1경 8,146조원) 대비 6,402조원(+35.3%) 증가

* ('19) 1경 7,946조원 → ('20) 1경 7,019조원 → ('21) 1경 8,146조원 → ('22) 2경 4,548조원

- 이는 '22년 중 금리 및 환율 변동성 확대에 따른 금융회사의 헤지 수요 증가로 **이자율스왑***(+3,063조원) 및 **통화선도****(+2,833조원) 거래 금액이 증가한 것에 기인

* (이자율스왑) : 이자율리스크 헤지를 위해 주기적으로 명목 원금에 대한 이자(주로 고정 및 변동금리)를 상호 교환하는 거래

** (통화선도) : 환리스크 헤지를 위해 미리 정한 가격으로 미래시점에 특정 통화를 매매하기로 하는 계약

- 한편, 상품별로는 **통화** 관련 거래(1경 7,030조원, 69.4%), 금융권역별로는 **은행**(1경 8,134조원, 73.9%)이 가장 큰 비중을 차지

장외파생상품 거래규모(단위 : 조원, %)				
구분	'20년	'21년	'22년	전년 대비 증감(비율)
거래규모	17,019	18,146	24,548	+6,402 (+35.3)
주식스왑	138	166	167	+1 (+0.6)
이자율스왑	3,496	4,070	7,133	+3,063 (+75.3)
통화선도	12,530	12,921	15,754	+2,833 (+21.9)
통화스왑	643	783	1,216	+433 (+55.3)
기타 ^{주)}	211	205	278	+73 (+35.6)

주) 기타는 주식선도, 주식옵션, 이자율선도, 이자율옵션, 통화옵션, 신용파생상품 등을 포함

- (거래잔액) '22년말 현재 국내 금융회사의 장외파생상품 거래잔액*은 1경 2,210조원으로 전년말(1경 1,305조원) 대비 905조원(+8.0%) 증가

* ('19말) 1경435조원 → ('20말) 9,935조원 → ('21말) 1경 1,305조원 → ('22말) 1경 2,210조원

- 상품별로는 이자율 관련 거래(7,556조원, 61.9%), 금융권역별로는 은행(9,683조원, 79.3%)이 가장 큰 비중을 차지
- 이는 전년말 대비 이자율스왑(+528조원) 및 통화스왑(+230조원) 거래잔액이 증가한 것에 기인

장외파생상품 거래잔액(단위 : 조원, %)				
구분	'20년말	'21년말	'22년말	전년말 대비 증감(비율)
거래잔액 ^{주1)}	9,935	11,305	12,210	+905 (+8.0)
주식스왑	51	57	73	+16 (+28.1)
이자율스왑	6,265	6,832	7,360	+528 (+7.7)
통화선도	2,132	2,650	2,704	+54 (+2.0)
통화스왑	1,219	1,471	1,701	+230 (+15.6)
기타 ^{주2)}	268	296	372	+76 (+25.7)

주1) 거래잔액은 기간말 기준 미청산 금액을 의미

주2) 기타는 주식선도, 주식옵션, 이자율선도, 이자율옵션, 통화옵션, 신용파생상품 등을 포함

II. 기초자산별 장외파생상품 거래현황

◆ (거래규모) 국내 금융회사의 장외파생상품 거래규모 중 **통화** 관련 거래가 **1경 7,030조원**(69.4%)으로 가장 큰 비중을 차지

- 그 다음으로 **이자율** 관련 7,206조원(29.4%), **주식** 관련 213조원(0.9%), **신용** 관련 48조원(0.2%) 등 순

◆ (거래잔액) 국내 금융회사의 장외파생상품 거래잔액 중 **이자율** 관련 거래가 **7,556조원**(61.9%)으로 가장 큰 비중을 차지

- 그 다음으로 **통화** 관련 4,425조원(36.2%), **신용** 관련 95조원(0.8%), **주식** 관련 90조원(0.7%) 등 순

※ 통화선도 거래는 주로 1년 미만(3, 6, 9, 12월)으로 거래되는 반면, 이자율스왑 거래는 주로 1년 이상 장기(1, 3, 5, 10, 20, 30년)로 거래

□ (통화 장외파생상품) '22년 중 통화 관련 장외파생상품 거래규모는 1경 7,030조원으로 전년(1경 3,776조원) 대비 **3,254조원 증가**(+23.6%)하였으며, 거래잔액은 4,425조원으로 전년말(4,150조원) 대비 **275조원 증가**(+6.6%)

○ 거래 유형별로는 **통화선도** 거래규모가 1경 5,754조원으로 전체 통화관련 거래 중 대부분(92.5%)을 차지

통화 관련 장외파생상품 거래규모 및 잔액 추이(단위 : 조원, %)				
구분	'20년	'21년	'22년	전년대비 증감(비율)
거래규모	13,250	13,776	17,030	+3,254 (+23.6)
통화선도	12,530	12,921	15,754	+2,833 (+21.9)
통화스왑	643	783	1,216	+433 (+55.3)
통화옵션	76	72	59	△13 (△18.1)
거래잔액	3,376	4,150	4,425	+275 (+6.6)
통화선도	2,132	2,650	2,704	+54 (+2.0)
통화스왑	1,219	1,471	1,701	+230 (+15.6)
통화옵션	25	29	20	△9 (△31.0)

- (이자율 장외파생상품) '22년 중 이자율 관련 장외파생상품 거래규모는 7,206조원으로 전년(4,117조원) 대비 3,089조원 증가(+75.0%)하였으며, 거래잔액은 7,556조원으로 전년말(6,984조원) 대비 572조원 증가(+8.2%)
- 거래 유형별로는 이자율스왑 거래규모가 7,133조원으로 전체 이자율 관련 거래 중 대부분(99.0%)을 차지

이자율 관련 장외파생상품 거래규모 및 잔액 추이(단위 : 조원, %)				
구분	'20년	'21년	'22년	전년대비 증감(비율)
거래규모	3,527	4,117	7,206	+3,089 (+75.0)
이자율선도	10	29	65	+36 (+124.1)
이자율스왑	3,496	4,071	7,133	+3,062 (+75.2)
이자율옵션	21	17	9	△8 (△47.1)
거래잔액	6,403	6,984	7,556	+572 (+8.2)
이자율선도	13	39	94	+55 (+141.0)
이자율스왑	6,265	6,832	7,360	+528 (+7.7)
이자율옵션	125	113	103	△10 (△8.8)

- (주식 장외파생상품) '22년 중 주식 관련 장외파생상품 거래규모는 213조원으로 전년(194조원) 대비 19조원 증가(+9.8%)하였으며, 거래잔액은 90조원으로 전년말(68조원) 대비 22조원 증가(+32.4%)
- 거래 유형별로는 주식스왑 거래규모가 167조원으로 전체 주식 관련 거래 중 가장 높은 비중(78.4%)을 차지

주식 관련 장외파생상품 거래규모 및 잔액 추이(단위 : 조원, %)				
구분	'20년	'21년	'22년	전년대비 증감(비율)
거래규모	193	194	213	+19 (+9.8)
주식선도	2	3	9	+6 (+200.0)
주식스왑	138	166	167	+1 (+0.6)
주식옵션	53	25	37	+12 (+48.0)
거래잔액	64	68	90	+22 (+32.4)
주식선도	0	1	2	+1 (+100.0)
주식스왑	51	57	73	+16 (+28.1)
주식옵션	13	10	15	+5 (+50.0)

- (신용 장외파생상품) '22년 중 신용 관련 장외파생상품 거래규모는 48.2조원으로 전년(18.0조원) 대비 30.2조원 증가(167.8%)하였으며, 거래잔액은 95.0조원으로 전년말(73.5조원) 대비 21.5조원 증가(29.3%)
- 거래 유형별로는 CDS 거래규모가 26.6조원으로 전체 신용 관련 거래 중 가장 높은 비중(55.2%)을 차지

신용 관련 장외파생상품 거래규모 및 잔액 추이(단위 : 조원, %)				
구분	'20년	'21년	'22년	전년대비 증감(비율)
거래규모	22.0	18.0	48.2	+30.2 (+167.8)
신용부도스왑(CDS)	10.1	7.9	26.6	+18.7 (+236.7)
총수익스왑(TRS)	4.9	4.6	19.0	+14.4 (+313.0)
기타 ^{주)}	7.1	5.5	2.0	△3.5 (△63.6)
거래잔액	74.6	73.5	95.0	+21.5 (+29.3)
신용부도스왑(CDS)	61.8	58.7	66.4	+7.7 (+13.1)
총수익스왑(TRS)	5.6	7.3	22.0	+14.7 (+201.4)
기타 ^{주)}	7.2	7.5	6.6	△0.9 (△12.0)

주) 신용연계채권(CLN), 합성 담보부채권(CDO), 신용연계통화스왑 등 포함

III. 금융권역별 거래현황

- ◆ (권역별 거래규모) 권역별 장외파생상품 거래규모는 은행이 1경 8,134조원(73.9%)으로 가장 큰 비중이며 증권 5,040조원(20.5%), 신탁 1,167조원(4.8%) 등 순
- ◆ (권역별 거래잔액) 권역별 장외파생상품 거래잔액은 은행이 9,683원(79.3%)으로 가장 큰 비중이며 증권 2,072조원(17.0%), 보험 234조원(1.9%) 등 순

- (권역별 거래규모) '22년 중 금융권역별 장외파생상품 거래규모는 은행이 1경 8,134조원으로 가장 높은 비중(73.9%)을 차지하고 있고, 그 다음으로 증권(5,040조원, 20.5%), 신탁(1,167조원, 4.8%) 등 순
- 은행의 장외파생상품 거래는 통화선도(1경 3,322조원) 및 이자율스왑(3,974조원) 등 장외파생상품 거래의 대부분을 차지

권역별 장외파생상품 거래규모(단위 : 조원, %)

구분	'22년	은행	증권	보험	신탁 ^{주1)}	기타 ^{주2)}
거래규모 (비중)	24,548 (100.0)	18,134 (73.9)	5,040 (20.5)	205 (0.8)	1,167 (4.8)	2 (0.0)
주식	213	2	150	1	61	0
이자율	7,206	4,004	3,154	46	1	1
통화	17,030	14,100	1,667	158	1,104	1
신용	48	14	34	0	0	0
기타 ^{주3)}	51	14	35	0	1	0

주1) 자산운용 펀드계정, 은행 및 증권사의 신탁계정으로 구성

주2) 증권사, 신용카드사, 선물회사 등으로 구성

주3) 귀금속 및 기타 금속, 농축수산물, 에너지 등 포함

- (권역별 거래잔액) '22년말 금융권역별 장외파생상품 거래잔액은 은행(9,683조원, 79.3%), 증권(2,072조원, 17.0%), 보험(232조원, 1.9%) 등 順

권역별 장외파생상품 거래잔액(단위 : 조원, %)

구분	'22년말	은행	증권	보험	신탁 ^{주1)}	기타 ^{주2)}
거래잔액 (비중)	12,210 (100.0)	9,683 (79.3)	2,072 (17.0)	234 (1.9)	210 (1.7)	11 (0.1)
주식	90	2	76	1	12	0
이자율	7,556	5,887	1,576	85	2	7
통화	4,425	3,769	310	148	195	4
신용	95	16	78	1	0	0
기타 ^{주3)}	44	10	32	0	1	0

주1) 자산운용 펀드계정, 은행 및 증권사의 신탁계정으로 구성

주2) 증권사, 신용카드사, 선물회사 등으로 구성

주3) 귀금속 및 기타 금속, 농축수산물, 에너지 등 포함

- (거래상대방별 거래규모) '22년 은행·증권회사의 거래상대방별 거래규모는 외국 금융회사*(44.0%), 외은지점(23.4%), 국내은행(14.1%) 등 順

* 외국 은행, 외국 IB, 외국 자산운용사 등 포함

- 이는 거래규모가 가장 큰 통화 및 이자율 관련 거래가 외국은행 등 외국 금융회사*와 외은지점을 통해 많이 발생하는 데 기인

* 외국 금융회사와의 거래는 이자율, 주식 및 통화 관련 장외파생상품 거래에서 각각 63.4%, 41.7%, 35.3%로 가장 높은 비중을 차지

IV. 장외파생상품 중개·주선 규모

- (거래규모) '22년 국내 금융회사의 장외파생상품 중개·주선 거래 규모는 393.1조원으로 전년(287.6조원) 대비 105.5조원 증가(+36.7%)
- 통화 관련 장외파생상품 중개·주선 거래금액이 181.6조원으로 전년 (93.0조원) 대비 1배 가량 증가(+88.6조원, +95.3%)
 - 이는 외국계 증권사·은행의 국내 지점 등의 통화선도 등 중개·주선 실적(+85.8조원, +94.9%)이 증가한 데 기인
 - 이자율(28.8조원 → 64.9조원) 및 상품(11.1조원 → 18.4조원) 등의 장외 파생상품 중개·주선 실적은 전년 대비 증가한 반면, 주식(136.6조원 → 106.7조원) 관련 장외파생상품 실적은 전년 대비 감소

장외파생상품 중개·주선 거래규모 추이(단위 : 조원, %)					
구분	'20년	'21년	'22년	전년대비 증감(비율)	
주식	160.5	136.6	106.7	△29.9	(△21.9)
이자율	16.2	28.8	64.9	+36.1	(+125.3)
통화	30.9	93.0	181.6	+88.6	(+95.3)
신용	11.4	11.7	15.8	+4.1	(+35.0)
상품	9.5	11.1	18.4	+7.3	(+65.8)
기타	2.9	6.4	5.8	△0.6	(△9.4)
합계	231.3	287.6	393.1	+105.5	(+36.7)