

해외대체투자 관련 통계치(2017년 말 기준)

<해외대체>

1. 해외대체 포트폴리오 현황 총괄

□ 해외대체 투자금액

(단위: 억 원, %)

구분	2015년		2016년		2017년	
	금액	비중	금액	비중	금액	비중
부동산	192,118	50.4	237,259	49.4	262,061	46.7
인프라	77,010	20.2	103,201	21.5	116,536	20.7
사모	111,938	29.4	139,588	29.1	171,328	30.5
헤지펀드	-	-	-	-	11,793	2.1
총 계	381,066	100.0	480,048	100.0	561,718	100.0

□ 해외대체 포트폴리오 구성

(단위: 건, 백만 달러)

		2016년				2017년 4분기			
		부동산	인프라	사모	해외대체	부동산	인프라	사모	해외대체
펀드 수 ¹⁾		121	57	113	291	129	70	126	325
약정금액		25,046	12,068	19,991	57,105	27,055	14,547	23,131	64,733
집행금액		19,832	6,953	11,551	38,336	22,658	10,877	15,991	49,526
투자잔액		13,825	5,980	8,053	27,858	14,681	8,929	9,881	33,491
투자 유형 ²⁾	프로젝트	5,872	3,055	1,201	10,128	5,756	4,064	1,428	11,248
	펀드	7,953	2,925	6,852	17,730	8,925	4,865	8,453	22,243
NAV ³⁾		17,108	7,700	9,421	34,229	17,455	11,555	12,189	41,199
NAV+잔여약정금액 ⁴⁾		21,864	13,460	18,648	53,972	24,874	16,417	21,347	62,638

주1) 개별 종목 기준으로 펀드 수는 위탁펀드와 프로젝트(블라인드 포함)의 합임

2) 투자잔액 기준

3, 4) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터 기준

□ 해외대체 지역별 투자현황(2017.4분기 기준)

(단위: 백만 달러, %)

구분	부동산		인프라		사모		해외대체 전체	
	금액	비중	금액	비중	금액	비중	금액	비중
아시아 ¹⁾	4,925	19.8	2,308	14.1	1,929	9.0	9,162	14.6
유럽지역	4,233	17.0	2,785	17.0	3,245	15.2	10,263	16.4
북미	11,866	47.7	3,327	20.2	6,698	31.4	21,891	34.9
남미	75	0.3	158	1.0	-	-	233	0.4
글로벌투자	3,775	15.2	7,838	47.7	9,476	44.4	21,089	33.7
전체 ²⁾	24,874	100.0	16,417	100.0	21,347	100.0	62,638	100.0

주1) 사모의 아시아 지역은 남미 소재 이머징 국가를 포함

인프라의 아시아 지역은 호주를 포함

2) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터의 2017년도 12월말 NAV+잔여약정금액 기준임

□ 해외대체 통화별 투자현황(2017.4분기 기준)

(단위: 백만 달러, %)

구분	부동산		인프라		사모		해외대체 전체	
	금액	비중	금액	비중	금액	비중	금액	비중
미국(USD)	17,950	72.2	11,480	69.9	17,857	83.7	47,287	75.5
유로(EUR)	3,458	13.9	1,760	10.7	3,222	15.1	8,440	13.5
호주(AUD)	1,426	5.7	1,619	9.9	-	-	3,045	4.9
영국(GBP)	639	2.6	1,134	6.9	269	1.3	2,042	3.3
일본(JPY)	701	2.8	-	-	-	-	701	1.1
기타	700	2.8	424	2.6	-	-	1,124	1.8
전체	24,874	100.0	16,417	100.0	21,347	100.0	62,639	100.0

주) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터의 2017년도 12월말

NAV+잔여약정금액 기준임

□ 해외대체 위탁운용 금액 및 비중(2017년)

(단위: 억 원, %)

구분	위탁금액	비중
부동산	149,630	100.0
인프라	101,584	100.0
사모	110,971	100.0
헤지펀드	11,793	100.0
소계	373,978	100.0

주) 집행금액 기준

2. 해외대체 유형별 포트폴리오 현황

□ 해외부동산 투자현황

(단위: 백만 달러)

구분	2016년 4분기 기준			2017년 4분기 기준		
	전체	프로젝트	펀드	전체	프로젝트	펀드
투자자산	121개	35개	86개	129개	36개	93개
약정금액	25,046	7,856	17,190	27,055	7,461	19,594
집행금액	19,832	8,681	11,151	22,658	9,335	13,323

□ 해외부동산 전략별 투자현황

(단위: %)

구분	2016년		2017년 4분기	
	프로젝트	펀드	프로젝트	펀드
Core	64.2	0.7	60.4	1.8
Core plus	0.0	43.8	0.0	48.8
Value-added	29.8	26.4	28.1	23.6
Opportunistic	5.9	29.0	11.5	25.8
전체	100.0	100.0	100.0	100.0

주) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터의 2017년도 12월말 NAV+잔여약정금액 기준임

□ 해외부동산 지역별 투자현황

(단위: 백만 달러, %)

구분	프로젝트		단독펀드		합동펀드		해외부동산	
	금액	비중	금액	비중	금액	비중	금액	비중
아시아	2,513	29.7	1,514	18.6	898	10.8	4,925	19.8
유럽지역	1,970	23.3	746	9.2	1,517	18.3	4,233	17.0
북미	3,983	47.0	4,553	56.0	3,330	40.2	11,866	47.7
남미	0	0.0	0	0.0	75	0.9	75	0.3
글로벌투자	0	0.0	1,319	16.2	2,456	29.7	3,775	15.2
전체	8,466	100.0	8,132	100.0	8,276	100.0	24,874	100.0

주) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터의 2017년도 12월말 NAV+잔여약정금액 기준임

□ 해외인프라 투자현황

(단위: 백만 달러)

구분	2016년 4분기 기준			2017년 4분기 기준		
	전체	프로젝트	펀드	전체	프로젝트	펀드
투자자산	57개	15개	42개	70개	18개	52개
약정금액	12,068	4,116	7,952	14,547	4,819	9,728
집행금액	6,953	3,313	3,640	10,877	4,555	6,322

□ 해외인프라 전략별 투자현황

(단위: %)

구분	2016년			2017년 4분기		
	프로젝트	펀드	해외인프라	프로젝트	펀드	해외인프라
Diversified	2	72	44	2	73	45
Energy	11	28	21	10	25	19
Midstream	47	-	19	40	-	16
Shipping	6	-	2	5	-	2
Telecom	5	-	2	4	-	2
Transportation	29	-	12	39	-	15
Aviation	-	-	-	-	2	1
전체	100	100	100	100	100	100

주) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터의 2017년도 12월말 NAV+잔여약정금액 기준임

□ 해외인프라 지역별 투자현황

(단위: 백만 달러, %)

구분	프로젝트		단독펀드		합동펀드		해외인프라	
	금액	비중	금액	비중	금액	비중	금액	비중
아시아 ¹⁾	1,187	18.5	-	-	1,121	14.7	2,308	14.1
유럽지역	1,576	24.6	-	-	1,209	15.9	2,785	17.0
북미	2,431	38.0	-	-	896	11.8	3,327	20.2
남미	-	-	-	-	158	2.1	158	1.0
글로벌투자	1,213	18.9	2,409	100.0	4,216	55.5	7,838	47.7
전체	6,407	100.0	2,409	100.0	7,600	100.0	16,417	100.0

주1) 인프라의 아시아 지역은 호주를 포함

주2) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터의 2017년도 12월말 NAV+잔여약정금액 기준임

□ 해외사모 투자현황

(단위: 백만 달러)

구분	2016년 4분기 기준			2017년 4분기 기준		
	전체	프로젝트	펀드	전체	프로젝트	펀드
투자자산	113개	11개	102개	126개	13개	113개
약정금액	19,991	2,146	17,846	23,131	2,742	20,389
집행금액	11,551	1,344	10,206	15,991	2,179	13,794

□ 해외사모 전략별 투자현황

(단위: %)

구분	2016년			2017년 4분기		
	프로젝트	펀드	해외사모	프로젝트	펀드	해외사모
대형 Buyout	23	31	30	57	36	38
중소형 Buyout	-	28	25	-	30	27
Credit/Mezz	77	16	22	43	12	16
Core	-	6	5	-	5	5
Distressed	-	10	9	-	8	7
Secondary	-	9	8	-	8	7
VC	-	1	1	-	1	0
기타	-	-	-	-	-	-
전체	100	100	100	100	100	100

주) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터의 2017년도 12월말 NAV+잔여약정금액 기준임

□ 해외사모 지역별 투자현황

(단위: 백만 달러, %)

구분	프로젝트		단독펀드		합동펀드		해외사모	
	금액	비중	금액	비중	금액	비중	금액	비중
아시아 ¹⁾	126	5.4	281	6.6	1,522	10.3	1,929	9.0
유럽지역	271	11.6	217	5.1	2,758	18.7	3,245	15.2
북미	1,559	66.6	692	16.4	4,447	30.1	6,698	31.4
남미	-	-	-	-	-	-	-	-
글로벌투자	385	16.5	3,043	71.9	6,048	40.9	9,476	44.4
전체 ²⁾	2,341	100.0	4,233	100.0	14,774	100.0	21,347	100.0

주1) 사모의 아시아/EM 지역은 남미 소재 이머징 국가를 포함

2) 해외대체투자 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터의 2017년도 12월말 NAV+잔여약정금액 기준임

□ 헤지펀드 투자전략별 비중

(단위: %)

구분	재간접펀드 운용사 A	재간접펀드 운용사 B	헤지펀드 전체
Equity Hedge	27.1	15.6	21.3
Event Driven	18.1	37.8	28.0
Macro	16.3	17.5	16.9
Relative Value	30.7	13.7	22.2
Multi&Others	7.7	15.4	11.6

주) 2017년말 기준

□ 헤지펀드 운용사별 투자현황

(단위: %, 백만달러)

구분	재간접펀드 운용사 A (5억 달러)		구분	재간접펀드 운용사 B (5억 달러)	
	비중	투자잔액		비중	투자잔액
펀드 A	5.5	27.5	펀드 1	2.7	13.4
펀드 B	7.7	38.5	펀드 2	3.5	17.5
펀드 C	4.8	24.0	펀드 3	3.8	19.2
펀드 D	5.5	27.5	펀드 4	5.9	29.7
펀드 E	5.5	27.5	펀드 5	0.2	1.0
펀드 F	7.0	35.0	펀드 6	5.0	25.0
펀드 G	7.0	35.0	펀드 7	12.5	62.5
펀드 H	5.1	25.2	펀드 8	6.0	30.0
펀드 I	2.1	10.5	펀드 9	5.0	25.0
펀드 J	1.8	9.2	펀드 10	3.0	15.0
펀드 K	5.5	27.5	펀드 11	2.1	10.6
펀드 L	6.1	30.2	펀드 12	10.0	50.0
펀드 M	6.6	32.7	펀드 13	4.5	22.4
펀드 N	6.0	30.0	펀드 14	7.5	37.5
펀드 O	6.0	30.0	펀드 15	3.5	17.5
펀드 P	12.1	60.0	펀드 16	4.3	21.3
펀드 Q	0.4	2.1	펀드 17	5.0	25.0
펀드 R	5.0	25.0	펀드 18	2.8	14.2
			펀드 19	1.8	9.0
			펀드 20	10.0	50.0
전체	100.0	497.4	전체	99.1	495.6

주 1) 2017년말 투자잔액 기준의 비중임 (현금, 신규편입 및 환매과정에서 전체 투자잔액과 하위운용사별 투자잔액의 차이 발생 가능)

2) 제3자 비밀유지 조항에 위배되지 않도록 투자잔액으로 변경하여 통계치 제공