해외채권 자산군 세부 내역

- 2012년도말 기준 -

□ 해외채권 포트폴리오 구성

< 종류별 투자 내역 >

구분	평가액(십억원)	비중(%)	비고
Treasuries	8,057	44.0	
Gov-related	457	2.5	
Municipal	48	0.3	
Corporate	7,870	43.0	
MBS	1,642	9.0	
기타	231	1.3	
합	18,305	100	

* 해외채권 개별종목별 합산 기준으로 위탁운용 자산 중 현금성자산 등은 비포함. 이하 동일

* Gov-related에는 준정부기관 및 초국가기관(supranational) 발행 채권 등이 포함

< 지역별 투자 내역 >

	구분	평가액(십억원)	비중(%)	비고
1	미국	7,560	41.3	
2	영국	1,837	10.0	
3	호주	1,006	5.5	
4	네덜란드	980	5.4	
5	독일	957	5.2	
6	캐나다	866	4.7	
7	일본	846	4.6	
8	한국	783	4.3	
9	프랑스	698	3.8	
10	스웨덴	286	1.6	
...	기타	2,487	13.6	
합		18,305	100	

□ 해외채권 투자 종목

< 상위 10개 투자 종목 내역 >

	종목	평가액(십억원)	비중(%)	종류	비고
1	T 4 1/2 11/15/15	361	2.0	Treasury	미국
2	T 4 1/2 02/15/16	300	1.6	Treasury	미국
3	TII 0 1/8 04/15/17	184	1.0	Treasury	미국
4	RFGB 3 1/2 04/15/21	173	1.0	Treasury	핀란드
5	JGB 1.2 12/20/20	173	1.0	Treasury	일본
6	OBL 2 02/26/16	172	0.9	Treasury	독일
7	T 5 3/8 02/15/31	154	0.8	Treasury	미국
8	UKT 4 3/4 03/07/20	147	0.8	Treasury	영국
9	UKT 3 3/4 09/07/21	137	0.8	Treasury	영국
10	TII 1 7/8 07/15/19	134	0.7	Treasury	미국
합		1,936	10.6		
전체 종목 합		18,305	100		