

## 사모투자 관련 통계치(2020년 말 기준)

### 1. 사모투자 포트폴리오 현황 총괄

#### □ 투자 금액

(단위: 억 원, %)

연번	구분	금액	비중	비고
1	부동산	290,686	34.9	
2	인프라	249,519	29.9	
3	사모	275,135	33.0	
4	헤지펀드	18,613	2.2	
총 계		833,953	100.0	

주) 투자잔액 기준

#### □ 투자 포트폴리오 구성

(단위: 건, 억 원)

구분		사모	헤지펀드
펀드수 <sup>1)</sup>		349	7
약정금액 <sup>2)</sup>		612,413	24,480
집행금액		342,299	18,834
투자잔액		275,135	18,613
투자유형 <sup>3)</sup>	프로젝트	55,166	-
	펀드	219,969	18,613
NAV <sup>4)</sup>		337,859	20,061
NAV+잔여약정금액 <sup>5)</sup>		560,541	24,480

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

2) 2020년 말 기준 청산 완료 펀드 및 출자가 이루어지지 않은 펀드 약정액은 제외

3) 투자잔액 기준

4, 5) 국내투자자는 NPF, 해외투자자는 모니터링 자문사인 Grosvenor 제공 데이터에 NPF 환율 적용

#### □ 위탁운용 금액 및 비중

(단위: 억 원, %)

연번	구분	위탁금액	비중	비고
1	부동산	287,821	99.0	
2	인프라	193,742	77.6	
3	사모	272,628	99.1	
4	헤지펀드	18,613	100.0	

주) 금액은 투자잔액 기준이며, 비중은 자산별 위탁운용 비중

□ 해외투자 지역별 투자현황

(단위: 억 원, %)

연 번	구 분	사 모		헤 지 펀 드	
		금 액	비 중	금 액	비 중
1	아시아 <sup>1)</sup>	16,182	8.9	-	-
2	유럽	30,417	16.7	-	-
3	북미	60,887	33.4	-	-
5	글로벌투자	75,075	41.0	18,613	100.0
전 체		182,561	100.0	18,613	100.0

주1) 아시아 지역은 남미 소재 이머징 국가를 포함

주2) 투자잔액 기준

□ 해외투자 통화별 투자현황

(단위: 억 원, %)

연 번	구 분	사 모		헤 지 펀 드	
		금 액	비 중	금 액	비 중
1	미국(USD)	146,860	80.4	18,613	100.0
2	유로(EUR)	33,335	18.3	-	-
3	호주(AUD)	1,366	0.7	-	-
4	영국(GBP)	-	-	-	-
5	일본(JPY)	-	-	-	-
6	기타	1,000	0.6	-	-
전 체		182,561	100.0	18,613	100.0

주) 투자잔액 기준

## 2. 유형별 포트폴리오 현황

### □ 투자현황

(단위: 억 원, %)

연번	구분	사모		헤지펀드	
		금액	비중	금액	비중
1	프로젝트	55,166	20.1	-	-
2	펀드	219,969	79.9	18,613	100.0
전체		275,135	100.0	18,613	100.0

주) 투자잔액 기준

### □ 사모 전략별 투자현황

(단위: 억 원, %)

연번	구분	프로젝트		펀드	
		금액	비중	금액	비중
1	Buyout	45,744	82.9	124,071	56.4
2	Growth	-	-	10,188	4.6
3	Credit/Mezz	904	1.6	22,579	10.3
4	Core	-	-	8,893	4.0
5	Distressed	-	-	16,446	7.5
6	Secondary	-	-	11,640	5.3
7	VC	-	-	10,835	4.9
8	Private Debt	5,215	9.5	3,498	1.6
9	CoPa	-	-	11,232	5.1
10	기타	3,303	6.0	588	0.3
전체		55,166	100.0	219,970	100.0

주) 투자잔액 기준

### □ 사모 지역별 투자현황

(단위: 억 원, %)

구분	프로젝트		펀드	
	금액	비중	금액	비중
국내	33,099	60.0	59,476	27.0
아시아 <sup>1)</sup>	1,133	2.1	15,050	6.8
유럽	4,531	8.2	25,886	11.8
북미	14,172	25.7	46,714	21.2
글로벌투자	2,231	4.0	72,844	33.2
전체	55,166	100.0	219,970	100.0

주1) 아시아 지역은 남미 소재 이머징 국가를 포함

주2) 투자잔액 기준

## □ 헤지펀드 투자전략별 비중

(단위: %)

연번	전략 구분	재 간접 펀드	싱글 펀드	헤지펀드 전체
1	Equity Hedge	22.3	35.0	27.2
2	Event Driven	20.6	20.0	20.4
3	Macro	2.1	25.8	11.2
4	Relative Value	28.5	19.2	24.9
5	Multi&Others	26.5	-	16.3
전체		100.0	100.0	100.0

주1) 투자잔액 기준

주2) Cash 등 포함