

กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ และ บริษัทย่อย
รายละเอียดประกอบเงินลงทุน - งบการเงินรวม
ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

รายละเอียด 2

	ร้อยละ	จำนวนหน่วย	ราคาหน้าตัว	มูลค่ายุติธรรม
หน่วย: บาท				
1. เงินฝากธนาคาร				
เงินฝากประจำ	0.67			
ธนาคารออมสิน		-	3,368,700,000.00	3,368,700,000.00
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)		-	11,855,107.00	11,855,107.00
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)		-	10,288,399.00	10,288,399.00
ธนาคารยูไนเต็ด โอเวอร์ซีส์ (ไทย) จำกัด (มหาชน)		-	26,008,025.00	26,008,025.00
รวม เงินฝากประจำ				3,416,851,531.00
บัตรเงินฝาก	0.12			
ธนาคารแห่งประเทศไทย จำกัด สาขาฮ่องกง		-	631,796,973.52	631,796,973.52
รวม บัตรเงินฝาก				631,796,973.52
รวม เงินฝากธนาคาร				4,048,648,504.52
2. ตราสารหนี้				
2.1 ตราสารหนี้ในประเทศ				
ตราสารหนี้ภาครัฐ				
พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรที่	53.67			
กระทรวงการคลังค้าประกัน และตั๋วเงินคลัง				
พันธบัตรรัฐบาล		-	210,291,585,000.00	223,397,212,089.00
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย		-	29,666,200,000.00	29,579,977,969.52
การเคหะแห่งชาติ		-	2,965,000,000.00	3,031,623,866.04
การไฟฟ้าฝ่ายผลิตแห่งประเทศไทย		-	60,000,000.00	63,311,996.20
การทางพิเศษแห่งประเทศไทย		-	5,466,300,000.00	5,631,884,621.83
การประปาส่วนภูมิภาค		-	500,000,000.00	507,664,135.00
การรถไฟแห่งประเทศไทย		-	7,545,280,000.00	7,882,134,743.02
ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร		-	150,000,000.00	152,409,556.50
ธนาคารอาคารสงเคราะห์		-	1,312,500,000.00	1,341,728,435.25
องค์การขนส่งมวลชนกรุงเทพ		-	1,120,000,000.00	1,152,275,048.80
รวม พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรที่				
 กระทรวงการคลังค้าประกัน และตั๋วเงินคลัง				272,740,222,461.16
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	1.82			
การไฟฟ้านครหลวง		-	315,000,000.00	354,106,608.45
การไฟฟ้าฝ่ายผลิตแห่งประเทศไทย		-	1,490,000,000.00	1,644,198,418.30
การไฟฟ้าส่วนภูมิภาค		-	6,733,000,000.00	7,111,466,410.60
ธนาคารอาคารสงเคราะห์		-	120,000,000.00	125,270,520.00
รวม พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ				9,235,041,957.35

กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ และ บริษัทย่อย
รายละเอียดประกอบเงินลงทุน - งบการเงินรวม
ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

รายละเอียด 2

	ร้อยละ	จำนวนหน่วย	ราคาหน้าตัว	มูลค่ายุติธรรม
หน่วย: บาท				
ตั๋วสัญญาใช้เงิน	2.34			
กระทรวงการคลัง	-	-	2,400,000,000.00	2,400,000,000.00
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	-	-	9,485,700,000.00	9,485,700,000.00
รวม ตั๋วสัญญาใช้เงิน				11,885,700,000.00
หุ้นกู้	2.65			
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	-	-	9,427,650,000.00	9,792,621,262.68
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)	-	-	2,228,587,000.00	2,254,232,201.91
บริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน)	-	-	1,410,000,000.00	1,438,105,795.69
รวม หุ้นกู้				13,484,959,260.28
รวม ตราสารหนี้ภาครัฐ				307,345,923,678.79
ตราสารหนี้สถาบันการเงิน				
ตัวแลกเปลี่ยน	10.18			
ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน)	-	-	1,593,000,000.00	1,593,000,000.00
ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน)	-	-	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	-	-	12,945,000,000.00	12,945,000,000.00
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	-	-	12,029,300,000.00	12,048,648,950.00
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	-	-	9,828,600,000.00	9,829,976,934.00
ธนาคารธนชาต จำกัด (มหาชน)	-	-	8,013,900,000.00	8,013,736,335.00
ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน)	-	-	3,432,000,000.00	3,432,000,000.00
ธนาคารทีสโก็ จำกัด (มหาชน)	-	-	2,870,300,000.00	2,870,281,469.62
รวม ตัวแลกเปลี่ยน				51,732,643,888.62
พันธบัตรสถาบันการเงินระหว่างประเทศ	0.87			
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	-	-	1,000,000,000.00	953,619,580.00
คอมมูนาลแบงก์เคอน เฮเอส	-	-	500,000,000.00	504,991,220.00
ธนาคารเพื่อการพัฒนาเอเชีย	-	-	45,000,000.00	48,205,179.90
ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย	-	-	280,000,000.00	281,372,994.00
ธนาคาร ไอเอ็นจี เอ็น.วี.	-	-	2,610,000,000.00	2,616,161,840.10
รวม พันธบัตรสถาบันการเงินระหว่างประเทศ				4,404,350,814.00
หุ้นกู้	0.10			
ธนาคารทีสโก็ จำกัด (มหาชน)	-	-	67,000,000.00	67,140,318.10
บริษัท ชิตตี้กรุ๊ป อิงก์	-	-	415,000,000.00	416,628,756.70
รวม หุ้นกู้				483,769,074.80
รวม ตราสารหนี้สถาบันการเงิน				56,620,763,577.42

กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ และ บริษัทย่อย
รายละเอียดประกอบเงินลงทุน - งบการเงินรวม
ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

รายละเอียด 2

หน่วย: บาท

	ร้อยละ	จำนวนหน่วย	ราคาหน้าตัว	มูลค่ายุติธรรม
ตราสารหนี้บริษัท				
หุ้นกู้	4.80			
บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน)	-	-	480,000,000.00	484,643,615.63
บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	-	-	180,000,000.00	182,079,500.25
บริษัท เมอร์เซเดส-เบนซ์ (ประเทศไทย) จำกัด	-	-	510,000,000.00	508,200,108.00
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	-	-	258,000,000.00	264,675,178.30
บริษัท โกลว์ พลังงาน จำกัด (มหาชน)	-	-	1,125,000,000.00	1,165,583,105.45
บริษัท ไดโอดต้า ลีสซิง (ประเทศไทย) จำกัด	-	-	2,925,000,000.00	2,917,633,761.75
บริษัท โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน)	-	-	75,000,000.00	76,666,390.50
บริษัท โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ จำกัด (มหาชน)	-	-	65,000,000.00	64,815,906.90
บริษัท ไทยยูเนี่ยน โฟรเซ่น โปรดักส์ จำกัด (มหาชน)	-	-	120,000,000.00	122,002,353.60
บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน)	-	-	4,302,350,000.00	4,341,523,937.25
บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	-	-	1,670,000,000.00	1,716,996,697.05
บริษัท ไออาร์พีซี จำกัด (มหาชน)	-	-	1,216,000,000.00	1,247,581,064.32
บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)	-	-	220,000,000.00	222,334,319.60
บริษัท กรุงเทพบ้านและที่ดิน จำกัด (มหาชน)	-	-	330,000,000.00	327,030,207.40
บริษัท กัลฟ์ โคนเนคชั่น จำกัด	-	-	63,000,000.00	66,361,681.89
บริษัท ควอลิตี้เฮาส์ จำกัด (มหาชน)	-	-	235,000,000.00	232,075,381.95
บริษัท ทุนธนาชาติ จำกัด (มหาชน)	-	-	90,000,000.00	92,377,585.80
บริษัท บ้านปู จำกัด (มหาชน)	-	-	1,960,000,000.00	1,999,920,167.40
บริษัท ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน)	-	-	1,335,000,000.00	1,338,372,461.75
บริษัท พญาบุศย์ เร็ลเอสเตท จำกัด (มหาชน)	-	-	225,000,000.00	221,065,318.50
บริษัท พีทีที โกลบอล เคมิคอล จำกัด (มหาชน)	-	-	740,215,000.00	698,558,199.15
บริษัท อยุธยา แคปปิตอล ออโต้ ลีส จำกัด (มหาชน)	-	-	4,524,000,000.00	4,530,691,301.38
บริษัท อีออน ธนรินทร์พาร์ก (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)	-	-	310,000,000.00	311,885,838.50
บริษัท แลนด์แอนด์เฮาส์ จำกัด (มหาชน)	-	-	385,600,000.00	386,867,477.97
บริษัท ดีเอที เอสพีวี จำกัด	-	-	359,000,000.00	434,514,083.76
บริษัท อีเทอนอล 4 นิติบุคคลเฉพาะกิจ จำกัด	-	-	455,000,000.00	456,639,992.90
รวมหุ้นกู้				24,411,095,636.95
รวม ตราสารหนี้บริษัท				24,411,095,636.95
รวม ตราสารหนี้ในประเทศ				388,377,782,893.16

กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ และ บริษัทย่อย

รายละเอียด 2

รายละเอียดประกอบเงินลงทุน - งบการเงินรวม

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

หน่วย: บาท

	ร้อยละ	จำนวนหน่วย	ราคาหน้าตัว	มูลค่ายุติธรรม
2.2 ตราสารหนี้ต่างประเทศ				
พันธบัตรรัฐบาล	4.40			
ประเทศสหรัฐอเมริกา	-	-	6,355,534,279.44	6,832,754,476.08
ประเทศญี่ปุ่น	-	-	3,657,766,007.48	3,724,044,135.55
ประเทศสหพันธ์สาธารณรัฐเยอรมนี	-	-	3,037,241,372.92	3,215,857,725.75
ประเทศสหราชอาณาจักรอังกฤษ	-	-	1,466,763,035.83	1,721,496,734.35
ประเทศแคนาดา	-	-	1,539,366,868.98	1,704,626,470.82
ประเทศออสเตรเลีย	-	-	762,351,331.87	825,795,120.56
ประเทศสหรัฐอเมริกาเม็กซิโก	-	-	545,353,525.35	589,457,792.75
ประเทศนิวซีแลนด์	-	-	401,305,263.26	463,637,588.51
ประเทศสาธารณรัฐโปแลนด์	-	-	435,144,437.90	432,690,446.48
ประเทศสาธารณรัฐอิตาลี	-	-	489,049,120.93	423,073,356.10
ประเทศสาธารณรัฐฝรั่งเศส	-	-	319,501,048.82	332,642,581.33
ประเทศสาธารณรัฐเกาหลี	-	-	227,937,874.51	245,863,025.13
ประเทศสาธารณรัฐแอฟริกาใต้	-	-	246,724,973.37	226,916,784.49
ประเทศราชอาณาจักรนอร์เวย์	-	-	197,251,652.58	206,627,457.62
ประเทศสาธารณรัฐฟินแลนด์	-	-	161,174,462.27	174,513,394.82
ประเทศมาเลเซีย	-	-	172,136,403.79	173,677,343.63
ประเทศเนเธอร์แลนด์	-	-	127,855,104.13	144,826,592.11
ประเทศราชอาณาจักรเดนมาร์ก	-	-	134,432,814.35	143,501,469.26
ประเทศสาธารณรัฐเช็ก	-	-	116,271,765.11	122,508,560.31
ประเทศราชอาณาจักรสวีเดน	-	-	106,277,274.52	112,782,319.07
ประเทศราชอาณาจักรสเปน	-	-	98,941,618.30	97,902,616.06
ประเทศฮังการี	-	-	110,151,262.00	96,357,231.79
ประเทศสาธารณรัฐสิงคโปร์	-	-	63,891,566.73	75,468,935.76
ประเทศสาธารณรัฐออสเตรเลีย	-	-	54,489,586.89	61,344,338.21
ประเทศสหรัฐอเมริกาฮาร์เบอร์เบตส์	-	-	51,442,800.00	61,249,931.52
ประเทศราชอาณาจักรเบลเยียม	-	-	38,921,133.49	39,637,872.24
ประเทศราชรัฐลักเซมเบิร์ก	-	-	36,872,652.78	38,029,584.27
ประเทศเครือรัฐบาฮามาส	-	-	27,962,160.00	31,542,578.26
ประเทศสาธารณรัฐสโลวีเนีย	-	-	36,872,652.78	30,889,883.26
ประเทศสาธารณรัฐเปรู	-	-	13,806,759.99	15,373,760.77
ประเทศรัฐกาตาร์	-	-	6,312,000.00	6,927,241.41
รวม พันธบัตรรัฐบาล				22,372,017,348.27

กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ และ บริษัทย่อย

รายละเอียด 2

รายละเอียดประกอบเงินลงทุน - งบการเงินรวม

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

หน่วย: บาท

	ร้อยละ	จำนวนหน่วย	ราคาหน้าตัว	มูลค่ายุติธรรม
ตราสารหนี้ที่ได้รับการจัดอันดับและอื่น ๆ	2.53			
ประเทศสหรัฐอเมริกา	-		6,762,495,316.03	7,139,515,760.62
ประเทศสหราชอาณาจักรอังกฤษ	-		1,055,332,726.35	1,096,457,428.79
ประเทศเนเธอร์แลนด์	-		729,010,474.21	770,241,011.06
ประเทศสาธารณรัฐเกาหลี	-		631,200,000.00	621,341,252.33
ประเทศสหพันธ์สาธารณรัฐเยอรมนี	-		537,333,011.19	556,850,579.03
ประเทศสาธารณรัฐฝรั่งเศส	-		363,580,000.35	373,117,987.78
ประเทศออสเตรเลีย	-		340,479,835.15	347,517,224.51
ประเทศไอร์แลนด์	-		326,845,145.10	342,018,626.45
ประเทศสาธารณรัฐฟิลิปปินส์	-		224,749,566.21	235,276,082.25
ประเทศแคนาดา	-		156,193,260.49	167,570,610.51
ประเทศสมาพันธรัฐสวิส	-		141,515,040.00	146,266,664.80
ประเทศสาธารณรัฐสิงคโปร์	-		127,329,155.46	144,170,816.05
ประเทศหมู่เกาะเคย์แมน	-		107,588,040.00	113,894,031.90
ประเทศราชรัฐลักเซมเบิร์ก	-		96,988,614.20	89,707,558.93
ประเทศสาธารณรัฐโปแลนด์แห่งแวนคูเอลา	-		61,068,600.00	62,009,399.13
ประเทศราชอาณาจักรสเปน	-		54,135,031.32	53,095,072.92
ประเทศราชอาณาจักรเบลเยียม	-		49,778,081.26	52,108,886.04
ตราสารหนี้ที่ได้รับการจัดอันดับและอื่น ๆ ที่มีมูลค่ายุติธรรมต่ำกว่า 50 ล้านบาท	-		387,434,318.27	524,042,706.41
รวม ตราสารหนี้ที่ได้รับการจัดอันดับและอื่น ๆ				12,835,201,699.51
รวม ตราสารหนี้ต่างประเทศ				35,207,219,047.78
รวม ตราสารหนี้				423,585,001,940.94

3. ตราสารทุน

3.1 ตราสารทุนในประเทศ

หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิถือหุ้น

หุ้นสามัญ	7.53			
ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)		117,700.00	-	2,090,808,025.00
ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน)		17,959,150.00	-	4,160,000.00
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)		11,840,950.00	-	1,817,585,825.00
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)		61,166,100.00	-	911,374,890.00
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)		28,893,650.00	-	635,660,300.00
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)		14,007,550.00	-	1,708,921,100.00
ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)		75,536,900.00	-	119,348,302.00
ธนาคารทีสโก้ จำกัด (มหาชน)		4,705,700.00	-	178,816,600.00
ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย		10,453,000.00	-	13,693,430.00