

2021년 1월 국민연금기금 운용수익률

□ 국민연금기금의 기금 전체 수익률은 연초 이후 2.35%(잠정)

- 자산별로 국내주식 5.24%, 해외주식 3.98%, 국내채권 0.01%, 해외채권 2.01%, 대체투자 1.86%를 기록하였음

* 금액가중수익률 기준

- 국내 및 해외주식은 코로나19 백신 접종 개시 및 경기 회복에 대한 기대감, 미 정치 리스크 완화, 추가 경기부양책에 대한 기대가 양호한 수익률에 기여하였음
원 달러 환율은 전년 대비 상승하였음

* 국내주식시장(KOSPI) 상승률 : 21년초~1월 3.58%

글로벌 주식시장(MSCI ACWI ex-Korea, 달러기준) 상승률 : 21년초~1월 1.30%

원 달러 환율 : 21년초~1월 2.44% 상승

- 국내채권 및 해외채권은 경기 회복에 대한 기대감 및 인플레이션 상승 우려로 금리가 상승하였으며, 원 달러 환율 상승으로 인한 외화환산이익이 해외채권 수익률에 기여하였음

* 국내채권 : 21년초~1월 국고채(3년) 0.2bp상승, 국고채(10년) 4bp상승

* 해외채권 : 21년초~1월 미국채(10년) 13.2bp상승

- 국내 및 해외 대체투자자산은 1월 중 안정적인 이자·배당수익 실현 및 원 달러 환율 상승으로 인한 외화환산이익이 수익률 상승에 기여하였으며, 연도 말 기준 연 1회 공정가치 평가를 하므로 연중 수익률은 공정가치 평가액이 반영되지 않은 수치임

- 국민연금기금의 설립 이후 연평균 누적수익률은 5.86%, 누적 수익금은 총 459.1조원으로 장기투자자로서 안정적인 수익률을 보이고 있음

□ 국민연금 운용수익률 현황

(금액가중수익률 기준, 단위 :십억원, %)

구 분	설립이후부터 (‘88~’21.1월)	2021년 현재(1월)		
	수익률	수익률	평가액	비중
기금자산 계	5.86	2.35	855,274	100.0
금융부문	5.79	2.36	854,103	99.9
국내주식	8.50	5.24	179,969	21.0
해외주식	9.02	3.98	201,330	23.5
국내채권	4.16	0.01	330,915	38.7
해외채권	4.05	2.01	47,630	5.6
대체투자	7.07	1.86	92,158	10.8
단기자금	3.38	0.21	2,101	0.2
공공부문	8.26	-	-	0.0
복지부문	5.99	0.01	181	0.0
기타부문	1.42	0.01	991	0.1

주1) 2021년 1월 수익률은 연환산하지 않은 기간 수익률이며, 대체투자 수익률은 공정가평가액이 반영되지 않은 수치임

주2) 2020년, 2021년 수치는 잠정치임