

## 2021년 2월 국민연금기금 운용수익률

### □ 국민연금기금의 기금 전체 수익률은 연초 이후 2.73%(잠정)

- 자산별로 국내주식 7.30%, 해외주식 5.57%, 국내채권 -0.70%, 해외채권 -0.54%, 대체투자 1.91%를 기록하였음

\* 금액가중수익률 기준

- 국내 및 해외주식은 코로나19 백신 접종 개시, 추가 경기부양책으로 인한 경기 회복에 대한 기대가 양호한 수익률에 기여하였음. 원 달러 환율은 전년 대비 상승하였음

\* 국내주식시장(KOSPI) 상승률 : 21년초~2월 4.85%

글로벌 주식시장(MSCI ACWI ex-Korea, 달러기준) 상승률 : 21년초~2월 3.37%

원 달러 환율 : 21년초~2월 1.88% 상승

- 국내채권 및 해외채권은 경기 회복 기대감으로 금리가 상승하였음. 이로 인한 평가손실증가로 전월 대비 수익률이 하락하였으며, 원 달러 환율 상승으로 외화 환산이익은 증가하여 해외채권 수익률의 하락폭을 제한하였음

\* 국내채권 : 21년초~2월 국고채(3년) 4.4bp상승, 국고채(10년) 24.8bp상승

\* 해외채권 : 21년초~2월 미국채(10년) 60.7bp상승

- 국내 및 해외 대체투자자산은 2월 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 5.90%, 누적 수익금은 총 462.2조원으로 장기투자자로서 안정적인 수익률을 보이고 있음

## □ 국민연금 운용수익률 현황

(금액가중수익률 기준, 단위 :십억원, %)

구 분	설립이후부터 (‘88~’21.2월)	2021년 현재(2월)		
	수익률	수익률	평가액	비중
기금자산 계	5.90	2.73	860,274	100
<b>금융부문</b>	5.83	2.73	859,255	99.9
국내주식	8.77	7.30	179,388	20.9
해외주식	9.32	5.57	206,440	24.0
국내채권	4.10	-0.70	332,463	38.6
해외채권	3.71	-0.54	47,193	5.5
대체투자	7.07	1.91	92,231	10.7
단기자금	3.36	0.17	1,540	0.2
공공부문	8.26	-	-	-
복지부문	5.99	0.09	183	0.0
기타부문	1.42	0.03	836	0.1

주1) 2021년 2월 수익률은 연환산하지 않은 기간 수익률이며, 대체투자 수익률은 공정가평가액이 반영되지 않은 수치임

주2) 2020년, 2021년 수치는 잠정치임