

2021년 3월 국민연금기금 운용수익률

□ 국민연금기금의 기금 전체 수익률은 연초 이후 3.94%(잠정)

- 자산별로 국내주식 9.08%, 해외주식 8.88%, 국내채권 -1.11%, 해외채권 1.59%, 대체투자 3.14%를 기록하였음

* 금액가중수익률 기준

- 국내 및 해외주식은 코로나19 백신 보급 및 추가 경기부양책으로 인한 글로벌 경기 개선 기대감으로 양호한 수익률을 보였음. 원 달러 환율은 전년 대비 상승하였음

* 국내주식시장(KOSPI) 상승률 : 21년초~3월 6.54%

글로벌 주식시장(MSCI ACWI ex-Korea, 달러기준) 상승률 : 21년초~3월 4.51%

원 달러 환율 : 21년초~3월 4.18% 상승

- 국내채권 및 해외채권은 경기 회복 기대감 및 인플레이션 우려 등으로 금리가 상승하였음. 이로 인한 평가손실증가로 국내채권은 전월 대비 수익률이 하락하였으나, 해외채권은 원 달러 환율 상승으로 인한 외화 환산이익 증가로 전월 대비 수익률이 상승하였음

* 국내채권 : 21년초~3월 국고채(3년) 16bp상승, 국고채(10년) 34bp상승

* 해외채권 : 21년초~3월 미국채(10년) 79bp상승

- 국내 및 해외 대체투자자산은 3월 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 6.03%, 누적 수익금은 총 472.3조원으로 장기투자자로서 안정적인 수익률을 보이고 있음

□ 국민연금 운용수익률 현황

(금액가중수익률 기준, 단위 :십억원, %)

구 분	설립이후부터 (‘88~’21.3월)	2021년 현재(3월)		
	수익률	수익률	평가액	비중
기금자산 계	6.03	3.94	872,524	100
금융부문	5.97	3.95	871,351	99.9
국내주식	9.00	9.08	178,673	20.5
해외주식	9.96	8.88	214,789	24.6
국내채권	4.07	-1.11	332,558	38.1
해외채권	3.99	1.59	48,957	5.6
대체투자	7.24	3.14	93,879	10.8
단기자금	3.39	0.44	2,495	0.3
공공부문	8.26	-	-	-
복지부문	5.99	0.20	184	0.0
기타부문	1.41	0.04	989	0.1

주1) 2021년 3월 수익률은 연환산 하지 않은 기간 수익률이며, 대체투자 수익률은 공정가평가액이 반영되지 않은 수치임

주2) 2020년, 2021년 수치는 잠정치임