

2020년 4월 국민연금기금 운용수익률

□ 국민연금기금의 기금 전체 수익률은 연초 이후 -2.57%(잠정)

- 자산별로 국내주식 -10.21%, 해외주식 -9.43%, 국내채권 1.25%, 해외채권 8.80%, 대체투자 4.78%를 기록하였음

* 금액가중수익률 기준

- 국내 및 해외증시는 코로나19의 전 세계적 확산에 실물경제가 위축되고 마이너스 유가를 기록하는 등 변동성이 확대되며 약세를 보임. 원달러 환율은 전년대비 상승하였음

* 국내주식시장(KOSPI) 상승률 : 20년초~4월 -11.38%

글로벌 주식시장(MSCI ACWI ex-Korea, 달러기준) 상승률 : 20년초~4월 -14.27%

원 달러 환율 : 20년초~4월 5.82%상승

- 국내주식 및 해외주식은 코로나19로 인한 기업 활동 및 국제무역의 일시중단으로 장기 경기침체 우려가 심화되며 수익률이 하락하였고,

- 국내채권 및 해외채권은 국내 및 글로벌 주요 국가의 코로나19 극복을 위한 적극적인 경기 부양책과 올해 전 세계 경제성장률 하락 전망에 금리 하락함. 그 결과 평가이익이 증가하였고, 원달러 환율 상승으로 외화 환산이익 또한 증가하며 채권 수익률이 상승하였음

* 국내채권 : 20년초~4월 국고채(3년) 34.5bp하락

* 해외채권 : 20년초~4월 미국채(10년) 129.1bp하락

- 국내 및 해외 대체투자자산의 4월 수익률은 대부분 이자 · 배당수익 및 원 달러 환율 상승에 의한 외화환산이익으로 인한 것이며, 연도 말 기준 연 1회 공정가치 평가를 하므로 연중 수익률은 공정가치 평가액이 반영되지 않은 수치임

- 국민연금기금의 설립이후 연평균 누적수익률은 4.98%, 누적 수익금은 총 348.7조원으로 장기투자자로서 안정적인 수익률을 보이고 있음

□ 국민연금 운용수익률 현황

(금액가중수익률 기준, 단위 :십억원, %)

구 분	설립이후부터 (‘88~’20.4월)	2020년 현재(4월)		
	수익률	수익률	평가액	비중
기금자산 계	4.98	-2.57	725,767	100.0
금융부문	4.88	-2.57	724,662	99.8
국내주식	3.76	-10.21	122,272	16.8
해외주식	5.97	-9.43	154,742	21.3
국내채권	4.46	1.25	319,650	44.0
해외채권	5.52	8.80	35,352	4.9
대체투자	8.28	4.78	89,915	12.4
단기자금	3.68	0.88	2,733	0.4
공공부문	8.26	-	-	-
복지부문	6.14	0.30	175	0.0
기타부문	1.50	0.12	929	0.1

주) 20년 4월 수익률은 연환산하지 않은 기간 수익률이며, 대체투자 수익률은 공정가평가액이 반영되지 않은 수치임