

2021년 5월 국민연금기금 운용수익률

□ 국민연금기금의 기금 전체 수익률은 연초 이후 5.82%(잠정)

- 자산별로 국내주식 12.98%, 해외주식 14.34%, 국내채권 -1.46%, 해외채권 0.59%, 대체투자 3.54%를 기록하였음

* 금액가중수익률 기준

- 국내 및 해외주식은 코로나19 재확산 우려에도 불구하고 주요 경제지표 개선 및 양호한 기업실적 등으로 경기 회복에 대한 기대가 지속되어 양호한 수익률을 보였으며, 이는 기금 전체 수익률 상승에 크게 기여하였음. 원 달러 환율은 전년 대비 상승하였음

* 국내주식시장(KOSPI) 상승률 : 21년초~5월 11.50%

글로벌 주식시장(MSCI ACWI ex-Korea, 달러기준) 상승률 : 21년초~5월 11.06%

원 달러 환율 : 21년초~5월 2.57% 상승

- 국내채권 및 해외채권은 코로나19 백신 보급에 따른 경기 회복 기대감, 경기 부양책에 따른 인플레이션 확대 우려 등으로 금리가 상승하였고 이로 인한 평가손실금액이 증가하였으나, 원달러 환율의 증가로 해외채권은 전월 대비 양호한 수익률을 보였음

* 국내채권 : 21년초~5월 국고채(3년) 26bp상승, 국고채(10년) 46bp상승

* 해외채권 : 21년초~5월 미국채(10년) 68bp상승

- 국내 및 해외 대체투자자산의 5월 수익률은 대부분 이자·배당수익 및 원 달러 환율 상승으로 인한 외화환산이익으로 인한 것이며, 연도 말 기준 연 1회 공정가치 평가를 하므로 연중 수익률은 공정가치 평가액이 반영되지 않은 수치임

□ 국민연금 운용수익률 현황

(금액가중수익률 기준, 단위 :십억원, %)

구 분	2021년 현재(5월)			설립이후부터 전년도말까지 (‘88~’20년말)
	수익률	평가액	비중	수익률
기금자산 계	5.82	892,283	100	6.27
금융부문	5.84	891,160	99.9	6.21
국내주식	12.98	180,031	20.2	8.99
해외주식	14.34	226,350	25.4	10.23
국내채권	-1.46	338,308	37.9	4.50
해외채권	0.59	50,571	5.7	4.36
대체투자	3.54	94,538	10.6	7.89
단기자금	0.23	1,362	0.2	3.61
공공부문	-	-	-	8.26
복지부문	0.36	192	0.0	6.09
기타부문	0.07	932	0.1	1.55

주1) 2021년 5월 수익률은 연환산 하지 않은 기간 수익률이며, 대체투자 수익률은 공정가평가액이 반영되지 않은 수치임

주2) 2021년 수치는 잠정치임