

厉害了我的社保基金！

8月18日，全国社会保障基金理事会（下称“社保基金会”）发布《社保基金年度报告（2020年度）》（下称“《报告》”）。《报告》显示，2020年，全国社保基金资产总额29226.61亿元，社保基金投资收益额3786.60亿元，投资收益率15.84%。据证券时报·券商中国记者统计，2020年末社保基金资产总额同比增长11.19%，并创下自2010年以来的最高收益率。

《报告》指出，2020年，面对错综复杂的国内外形势特别是突如其来的新冠肺炎疫情，社保基金会统筹抓好疫情防控和基金投资，在严密防范化解风险，确保基金安全的基础上，稳健审慎开展投资运营。

Wind数据显示，到2021年上半年，社保基金已重仓超140只个股。其中，上半年社保基金重仓前十的个股分别是紫金矿业、赤峰黄金、厦门象屿、三安光电、常熟银行、东方财富、中信特钢、杉杉股份、福田汽车、中国巨石。上半年社保基金加仓前五的个股分别是华工科技、华贸物流、高能环境、三环集团、中国巨石。

2020年社保基金资产总额同比增长11.19%

《报告》显示，2020年末，社保基金资产总额29226.61亿元。据证券时报·券商中国记者测算，相比于2019年末的社保基金资产总额26285.66亿元，2020年末社保基金资产总额同比增长11.19%。

其中，直接投资资产10146.53亿元，占社保基金资产总额的34.72%；委托投资资产19080.08亿元，占社保基金资产总额的65.28%。境内投资资产26393.12亿元，占社保基金资产总额的90.31%；境外投资资产2833.49亿元，占社保基金资产总额的9.69%。

《报告》指出，2020年社保基金经批准的境内投资范围包括银行存款、债券、信托贷款、资产证券化产品、股票、证券投资基金、股权投资、股权投资基金等；经批准的境外投资范围包括银行存款、银行票据、大额可转让存单等货币市场产品、债券、股票、证券投资基金，以及用于风险管理的掉期、远期等衍生金融工具等。

同时，《报告》明确，社保基金会坚持长期投资、价值投资和责任投资的理念，按照审慎投资、安全至上、控制风险、提高收益的方针进行投资运营管理，确保基金安全，实现保值增值。

社保基金会副理事长陈文辉在今年财新夏季峰会上曾表示，要关注“双碳”数字化，这将对我国经济社会变革产生深刻的影响。新能源汽车的产业链就是“双碳”数

字化变革的一个典型的行业。新能源汽车产业链是最具有投资价值的一个领域。

投资收益率15.84%，创10年新高

《报告》显示，2020年，社保基金投资收益额3786.60亿元，投资收益率15.84%。其中，已实现收益额2045.74亿元（已实现收益率9.58%），交易类资产公允价值变动额1740.86亿元。

值得注意的是，2020年社保基金投资收益率不仅远高于自成立以来的年均投资收益率，还是自2010年以来的最高收益率（2009年社保基金投资收益率为16.12%）。

从整体情况来看，2020年的社保基金收益情况也表现抢眼。社保基金自成立以来的年均投资收益率8.51%，累计投资收益额16250.66亿元。2020年，财政性拨入全国社保基金资金313.81亿元，截至2020年末，财政性拨入全国社保基金资金和股份累计9930.31亿元。意味着2020年的社保基金累计投资收益额远大于累计财政净拨入额。

在投资运营管理上，《报告》披露，2020年，社保基金会发力强化决策的科学性和权威性、科学合理配置基金资产、提高基金投资运营能力、积极推进全流程风险控制。

在科学合理配置基金资产方面，《报告》提出，社保基金会密切关注、科学研判疫情冲击、资本市场波动等重要情况和突发事件影响，加强对股市、债市和汇市的跟踪监测，增强预见性和主动性。

在提高基金投资运营能力方面，《报告》提出，社保基金会在防范市场风险的同时努力提高投资回报。完善固定收益产品布局，强化银行存款信用风险管理。服务国家战略，开展重大项目直接投资，加大股权基金投资力度，更好满足先进制造业、战略性新兴产业和科技创新产业的投融资需求。

上半年社保基金已重仓147只个股

《报告》指出，2020年末，社保基金负债余额2438.48亿元，主要是社保基金在投资运营中形成的短期负债。社保基金权益总额为26788.13亿元，包括全国社保基金权益24591.23亿元，其中，累计财政性净拨入9909.63亿元，累计投资增值余额14681.60亿元（其中累计投资收益余额14041.64亿元，基金公积和报表折算差额合计639.96亿元）。

《报告》还指出，个人账户基金权益1486.76亿元，其中，委托本金余额774.92亿

元，累计投资收益余额711.84亿元。地方委托资金权益710.14亿元，其中，委托本金余额500亿元，累计投资收益余额210.14亿元。

Wind数据显示，2020年全年社保基金重仓超600只个股。其中，去年社保基金重仓前十的个股分别是农业银行、工商银行、中国人保、交通银行、节能风电、紫金矿业、洛阳钼业、TCL科技、中国建筑、南山铝业。