

退撫基金辦理全球高品質 ESG 指數股票型國外委託案

近年由於消費者環保意識提升、社會對氣候變遷關切等意識抬頭，投資人逐漸重視 ESG 投資，特別是大型法人機構或是各國退休基金，有其社會責任推行具有正面社會效應之投資。而受到新冠肺炎疫情影響，研究顯示 ESG 相關策略之風險調整後報酬表現較佳，更突顯此次疫情後永續投資之重要性。

社會責任投資一直為退撫基金重要投資政策之一，在國外投資部分，除要求受託機構於經營計畫建議書詳細載明公司治理及社會責任投資理念納入選股之過程及方法，期能確實選擇具永續發展前景及善盡企業社會責任之績優公司外，為更加強化企業重視 ESG（環境、社會與公司治理）理念，退撫基金於 110 年度將 ESG 納入國外委託經營之委託類型，透過整合 ESG 投資，多元化海外投資收益來源，更期許透過資本市場力量，導引企業善盡社會責任。

退撫基金 110 年度國外委託案之類型為全球高品質 ESG

指數股票型，績效評估參考指標為 MSCI 全球高品質 ESG Target 指數 (MSCI ACWI Quality ESG Target Index)，在選股過程中業就 5 大層面：環境(Environment)、人權及社會(Human rights & Community)、勞工權益及供應鏈 (Labor rights & Supply chain)、顧客端 (Customers) 及治理面 (Governance)，共 28 項指標項目進行評估。本次委託總額度為 4 億美元，委託期間為 5 年，由 BlackRock Financial Management Inc.及 UBS Asset Management (Hong Kong) Limited 等 2 家受託機構各獲得 2 億美元之委託金額。