

MITTEILUNG AN DIE ANTEILINHABER DES AVIVA INVESTORS – MULTI-STRATEGY TARGET RETURN FUND

Luxemburg, den 30. Juni 2023

Sehr geehrte Anteilinhaberin, sehr geehrter Anteilinhaber,

wir möchten Sie darüber informieren, dass der Anlageverwalter beschlossen hat, seine ESG Baseline Exclusions Policy (die „BEP“) zu überprüfen, insbesondere wenn es um ein indirektes Engagement über den Einsatz von Derivaten in ausgeschlossenen Emittenten geht.

Im Zusammenhang mit dieser Überprüfung wurde die Beschreibung des Abschnitts „Derivate und Techniken“ und des RTS-Anhangs II – Vorvertragliche Angaben des Aviva Investors – Multi-Strategy Target Return Fund (der „Teilfonds“) angepasst, um die Änderung wie unten beschrieben widerzuspiegeln. Sie tritt am 1. August 2023 (das „Datum des Inkrafttretens“) in Kraft.

1. Derivate und Techniken

Mit Wirkung zum Datum des Inkrafttretens wird die Beschreibung des Abschnitts „Derivate und Techniken“ des Prospekts wie folgt geändert:

„Derivate und Techniken

Der Teilfonds setzt in großem Umfang Derivate zu Anlagezwecken ein, indem er Long- und synthetische Short-Positionen in Indizes, Wertpapieren und Wertpapierkörben sowie Relative-Value-Zinsswap-Strategien eingeht (...) Die Derivate des Teilfonds können Futures, Optionen, Swap-Kontrakte, Swaptions, Total Return Swaps, Devisentermingeschäfte (lieferbar oder nicht lieferbar), Devisenoptionen, Credit Default Swaps sowie Zinsswaps umfassen. ~~Um das Engagement zu begrenzen, wird das gesamte Long-Engagement über Derivate in ausgeschlossenen Wertpapieren vierteljährlich überwacht, damit 7,5 % des deltagewichteten Nennwerts nicht überschritten werden. Wenn dieser Wert überschritten wird, wird er bis zum nächsten Quartal wieder innerhalb der Toleranz reduziert.~~

(...)“

2. Wie werden durch den Einsatz von Derivaten die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Mit Wirkung zum Datum des Inkrafttretens wird der Abschnitt „Wie werden durch den Einsatz von Derivaten die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?“ im RTS-Anhang II – Vorvertragliche Angaben des Teilfonds wie folgt geändert:

„Derivate, die zu Anlagezwecken eingesetzt werden, werden nach Möglichkeit auf „Look-through“-Basis bewertet.

~~Um jedes mögliche Engagement zu begrenzen, wird das Engagement über Derivate in Wertpapieren, die durch die ESG Baseline Exclusions Policy des Anlageverwalters ausgeschlossen werden, vierteljährlich überwacht, damit 7,5 % des deltagewichteten Nennwerts nicht überschritten werden. Dies bildet das indirekte Engagement des Teilfonds durch breit angelegte Indexderivate nach. Engagements in Single-~~

Name-Derivaten werden gemäß den verbindlichen Kriterien ausgeschlossen, die sicherstellen, dass die zugrunde liegenden Anlagen auch Wertpapiere umfassen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, wie im Abschnitt „Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden durch dieses Finanzprodukt beworben? (...)“

Dies ist darauf zurückzuführen, dass der Anlageverwalter anerkennt, dass ein indirektes Engagement in ausgeschlossenen Emittenten über gut diversifizierte Finanzindizes aufgrund des standardmäßigen, breit angelegten Charakters dieser Indizes nur gelegentlich möglich ist. Außerdem werden die nun in der aktualisierten BEP enthaltenen Sicherungsmaßnahmen in Bezug auf indirekte Anlagen über nicht diversifizierte Finanzindizes, wie nachstehend beschrieben, berücksichtigt.

Bitte beachten Sie, dass die aktualisierte BEP die folgenden Bedingungen für Anlagen in Derivaten oder Aktien umfasst, die ein Engagement in einem nicht diversifizierten Finanzindex ermöglichen:

Die Richtlinie verbietet direkte Anlagen in Finanzinstrumenten, die von einem ausgeschlossenen Emittenten begeben werden, aber auch indirekte Anlagen über den Einsatz von Derivaten in Finanzinstrumenten, die von einem ausgeschlossenen Emittenten begeben werden, falls sie die nachstehenden Bedingungen nicht erfüllen:

„(...) Derivate- oder aktienbasiertes Engagement in einem nicht diversifizierten Finanzindex, bei dem das Gesamtengagement in ausgeschlossenen Emittenten höchstens 20 % der Gewichtung des Finanzindex beträgt, vorausgesetzt, dass das Gesamtengagement des Fonds oder Portfolios in ausgeschlossenen Emissionen über solche nicht diversifizierten Finanzindizes nicht 2,5 % des NIW überschreitet.“

Die aktualisierte BEP ist ab dem 1. August 2023 auf der Aviva Investors-Website unter dem folgenden Link verfügbar: <https://www.avivainvestors.com/en-lu/about/responsible-investment/policies-and-documents/>

Wenn Sie mit diesen Änderungen nicht einverstanden sind, können Sie die kostenlose Rücknahme oder den Umtausch Ihrer Anteile bis zum 31. Juli 2023 in beliebige der anderen Teilfonds des Fonds beantragen, wobei die im Verkaufsprospekt genannten Bedingungen Anwendung finden.

Eine aktualisierte Fassung des Prospekts mit Datum Juli 2023, der die oben genannte Änderung enthält, ist demnächst verfügbar und kann kostenlos beim Geschäftssitz des Fonds angefordert werden.

Hervorgehobene Begriffe, die hier nicht näher erläutert werden, haben dieselbe Bedeutung wie im Prospekt des Fonds.

Der aktuelle Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind über die Webseite www.eifs.lu/aviva-investors erhältlich. Sie sind ausserdem kostenlos erhältlich von der Verwaltungsgesellschaft, Aviva Investors Luxembourg S.A., 2, rue du Fort Bourbon, L-1249 Luxembourg, die die Einrichtungen für Anleger vor Ort bereitstellt.

AVIVA INVESTORS

Société d'Investissement à Capital Variable
Eingetragener Geschäftssitz: 2 rue du Fort Bourbon, L-1249 Luxembourg
R.C.S. Luxembourg B 32 640
(der „Fonds“)



Wenn Sie weitere Informationen zu den oben genannten Änderungen benötigen, wenden Sie sich bitte an die folgende E-Mail-Adresse: csaviva@rbc.com.

Mit freundlichen Grüßen

A handwritten signature in black ink that reads "Paula Concordea".

Paula Concordea
Im Namen des Verwaltungsrats