

DJE Investment S.A.

4, rue Thomas Edison

L-1445 Strassen, Luxembourg

R.C.S. Luxembourg B 90412

Mitteilung an die Anleger des Fonds

DJE Strategie II

mit seinem Teilfonds

DJE Strategie II – DJE Strategie Global

A (EUR) ISIN : LU0377287643 ; WKN: A0Q6BJ

B (EUR) ISIN : LU0377290357 ; WKN: A0Q6BK

C (EUR) ISIN : LU0377290787 ; WKN: A0Q6BL

Hiermit werden die Anleger der oben genannten Anteilklassen informiert, dass mit Wirkung zum 10. März 2023 folgende Änderungen in Kraft treten:

I. Anpassungen im Verwaltungsreglement / Anlagegrenzen

Im Rahmen der Umsetzung der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission vom 6. April 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 (SFDR Level 2) werden für die o.g. Teilfonds die nachfolgenden Ausschlusskriterien aufgenommen:

Es werden Unternehmen ausgeschlossen, die in den folgenden kontroversen Geschäftsfeldern tätig sind und Umsätze durch die Involvierung in folgenden Geschäftsfeldern generieren:

....

–Einstufung „Rot“ bei Kontroversen in Bezug auf die Umwelt¹

–Einstufung „Rot“ bei Kontroversen in Bezug auf das Klima²

...

Die neu aufgeführten Ausschlüsse bedingen keine Änderungen an dem Portfolio des Teilfonds.

Aufgrund einer Veröffentlichung der luxemburgischen Aufsichtsbehörde erfolgt eine Klarstellung zu flüssigen Mitteln in der Anlagepolitik des Teilfonds sowie in Art. 4 des Verwaltungsreglements dahingehend, dass unter Berücksichtigung der für den Teilfonds geltenden Anlagegrenzen der

¹ Environmental Controversy Flag: Bei diesem Indikator geht es um die Bewertung von Kontroversen (falls vorhanden) im Zusammenhang mit den Auswirkungen eines Unternehmens auf die Umwelt. Zu den Faktoren, die sich auf diese Bewertung auswirken, gehört, ob ein Unternehmen in Kontroversen im Zusammenhang mit Landnutzung und Biodiversität, Freisetzung von Giftstoffen, Energie und Klimawandel, Wassermanagement, nicht gefährlichen Betriebsabfällen, Umweltauswirkungen von Produkten und Dienstleistungen und dem Management der Umweltauswirkungen der Lieferkette verwickelt ist.

² Environment Climate Flag: Dieser Indikator misst die Schwere der Kontroversen im Zusammenhang mit der Politik und den Initiativen eines Unternehmens im Bereich Klimawandel und Energie. Zu den Faktoren, die sich auf diese Bewertung auswirken, gehören unter anderem eine frühere Verwicklung in Rechtsfälle im Zusammenhang mit Treibhausgasen, weit verbreitete oder ungeheuerliche Auswirkungen aufgrund von Treibhausgasemissionen des Unternehmens, Widerstand gegen verbesserte Praktiken und Kritik von NGO's und/oder anderen Beobachtern.

Teilfonds zur Erreichung des Anlageziels und/oder zur Liquiditätssteuerung und/oder im Falle ungünstiger Marktbedingungen sein Netto-Teilfondsvermögen in Geldmarktinstrumente im Sinne des Artikel 4 Nr. 1 c) des Verwaltungsreglements, Einlagen bei Kreditinstituten im Sinne des Artikel 4 Nr. 1 d) des Verwaltungsreglements und in Geldmarktfonds anlegen kann.

Daneben darf der Teilfonds bis zu 20% seines Netto-Teilfondsvermögens in flüssigen Mitteln halten.

Diese flüssigen Mittel beschränken sich auf das Halten von Sichteinlagen, zur Deckung laufender oder außergewöhnlicher Zahlungen oder für den Zeitraum, der für die Wiederanlage in zulässige Vermögenswerte erforderlich ist, oder für einen unbedingt erforderlichen Zeitraum im Falle ungünstiger Marktbedingungen. Bei außergewöhnlich ungünstigen Marktbedingungen (bspw. der Angriff am 11. September 2001, Insolvenz der Lehman Brothers Bank usw.) ist es zulässig, vorübergehend mehr als 20% an flüssigen Mitteln zu halten, wenn die Umstände dies erfordern und soweit dies im Hinblick auf die Interessen der Anleger gerechtfertigt erscheint.

II. Anpassungen im Verkaufsprospekt aufgrund der Offenlegung von Informationen im Zusammenhang mit ESG

Im Zusammenhang der Umsetzung der Vorgaben der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission vom 6. April 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 (SFDR Level 2) werden folgende Passagen bzw. Änderungen im Verkaufsprospekt aufgeführt bzw. vorgenommen:

- Einführung des Abschnittes „Berücksichtigung von nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren“ zwecks Beschreibung der *principle adverse impacts*
- Erläuterungen zum Verfahren der Verwaltungsgesellschaft zur Messung des Nachhaltigkeitsrisikos im Abschnitt „Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken“

Ergänzend wird der Verkaufsprospekt um das Template gemäß Anhang II SFDR Level 2 erweitert.

III. Ergänzung Risikohinweis „Risiko von ESG-Investitionen“

In dem Abschnitt „Risikohinweise“ wird der Risikohinweis „Risiko von ESG-Investitionen“ um folgenden Hinweis ergänzt:

Zur Bewertung eines Wertpapiers oder eines Emittenten auf Grundlage von ESG-Kriterien kann die Verwaltungsgesellschaft auf Informationen und Daten Dritter (u.a. ESG-Datenanbieter) angewiesen sein. Diese Daten können möglicherweise unvollständig, fehlerhaft oder nicht verfügbar sein. Daher besteht ein Risiko, dass die Verwaltungsgesellschaft aufgrund dieser Daten ein Wertpapier oder einen Emittenten falsch beurteilt bzw. bewertet, so dass ein Wertpapier zu Unrecht in das Portfolio des Fonds aufgenommen oder daraus ausgeschlossen wird.

Bei den Zahlstellen, der Verwahrstelle, der Vertriebsstelle sowie der Verwaltungsgesellschaft sind ab dem 10. März 2023 der aktualisierte Verkaufsprospekt nebst Verwaltungsreglement kostenlos erhältlich.



Strassen, 9. März 2023

DJE Investment S.A.

Informationsstellen in der Bundesrepublik Deutschland:

DZ BANK AG, Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main, Platz der Republik, D-60265 Frankfurt am Main und DJE Kapital AG, Pullacher Straße 24, D-82049 Pullach.