

Xtrackers US Treasuries Ultrashort Bond UCITS ETF

Nachtrag zum Prospekt

Dieser Nachtrag enthält Informationen zum Xtrackers US Treasuries Ultrashort Bond UCITS ETF (der „**Fonds**“), einem Teilfonds der Xtrackers (IE) plc (die „**Gesellschaft**“), einer offenen Investmentgesellschaft mit getrennter Haftung der Teilfonds, variablem Kapital und Umbrella-Struktur, die irischem Recht unterliegt und von der Central Bank of Ireland (die „**Central Bank**“) zugelassen wurde.

Dieser Nachtrag bildet einen Bestandteil des Prospekts, darf nur gemeinsam mit diesem ausgehändigt werden (außer an Personen, die den Prospekt der Gesellschaft vom 15. Juni 2023 (der „Prospekt“) bereits zu einem früheren Zeitpunkt erhalten haben) und ist in Verbindung mit dem Prospekt zu lesen.

Xtrackers (IE) plc

Datum: 2. Oktober 2023

WICHTIGE INFORMATIONEN

Der Fonds ist ein Exchange Traded Fund (ETF). Die Anteile dieses Fonds sind vollständig auf Anleger übertragbar und werden zum Handel an einer oder mehreren Börsen zugelassen.

BEDINGUNGEN DER ANTEILE, DIE BETEILIGUNGEN AN DEM FONDS REPRÄSENTIEREN

Anlageziel

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, die Wertentwicklung des Basiswertes, des FTSE US Treasury Short Duration Index (der „**Referenzindex**“), vor Gebühren und Aufwendungen abzubilden. Der Referenzindex spiegelt die Wertentwicklung von Staatsanleihen mit kurzer Laufzeit wider, die von der US-Regierung begeben werden.

Der Referenzindex umfasst von der US-Regierung begebene Staatsanleihen, die spezifische Anforderungen in Bezug auf Laufzeit und Liquidität erfüllen. Weitere Informationen zum Referenzindex finden sich im Abschnitt „Allgemeine Angaben zum Basiswert“.

Anlagepolitik

Um das Anlageziel zu erreichen, verfolgt der Fonds eine direkte Anlagepolitik. Es kann keine Zusicherung dahingehend gegeben werden, dass das Anlageziel des Fonds tatsächlich erreicht wird.

Der Fonds zielt darauf ab, die Wertentwicklung des Referenzindex, vor Gebühren und Aufwendungen, durch ein Portfolio von festverzinslichen Wertpapieren, das alle oder einen repräsentativen Teil der im Referenzindex enthaltenen Wertpapiere oder nicht damit in Zusammenhang stehende übertragbare Wertpapiere (die „**Basiswertpapiere**“) umfasst, zu replizieren oder abzubilden. Der Fonds wird nach einem passiven Ansatz verwaltet und er ist ein Fonds mit Optimierter Replikation (wie im Prospekt unter der Überschrift „*Fonds mit Direkter Anlagepolitik und passivem Ansatz*“ beschrieben). Die festgelegte optimierte Auswahl von Wertpapieren wird mit dem Ziel ausgewählt, die repräsentativste Auswahl des Referenzindex zu bieten, basierend auf dessen Bewertung der Basiswertpapiere unter Berücksichtigung von Faktoren, zu denen insbesondere die Korrelation der Basiswertpapiere mit dem Referenzindex und das Engagement, die Liquidität und das Risiko der zugrunde liegenden Wertpapiere zählen. Alle nicht damit in Zusammenhang stehenden übertragbaren Wertpapiere, die vom Fonds gehalten werden, sind in der Regel mit den im Referenzindex enthaltenen Wertpapieren vergleichbar. Vollständige Angaben zur Zusammensetzung des Portfolios des Fonds werden täglich unter www.Xtrackers.com zur Verfügung gestellt.

Die Basiswertpapiere sind an den in Anhang I des Prospekts angegebenen Märkten oder Börsen notiert oder werden an diesen gehandelt und der Fonds erwirbt die Basiswertpapiere von einem Broker oder einem Kontrahenten, der an den in Anhang I des Prospekts angegebenen Märkten oder Börsen handelt.

Wie im nachstehenden Abschnitt „Effizientes Portfoliomanagement und derivative Finanzinstrumente“ und im Prospekt näher beschrieben, kann der Fonds zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements auch in Wertpapiere, bei denen es sich nicht um Bestandteile des Referenzindex handelt, und/oder auf einen Bestandteil des Referenzindex bezogene derivative Finanzinstrumente („**FDI**“) investieren, wenn diese Wertpapiere und/oder FDI ein dem Referenzindex, einem Bestandteil des Referenzindex oder einer Untergruppe von Bestandteilen des Referenzindex vergleichbares Risiko- und Renditeprofil haben.

Der Fonds kann Anlagen in zusätzliche liquide Vermögenswerte tätigen, zu denen besicherte und/oder unbesicherte Einlagen und/oder Anteile anderer OGAW bzw. anderer Organismen für gemeinsame Anlagen zählen, die eine Geldmarkt- oder Barmittelstrategie verfolgen oder die sich auf den Referenzindex oder Bestandteile des Referenzindex beziehen.

Diese Anlagen und liquiden Vermögenswerte, die der Fonds daneben halten darf, werden zusammen mit etwaigen Gebühren und Aufwendungen gemäß den Bestimmungen im Hauptteil des Prospekts zur Ermittlung des Nettoinventarwerts des Fonds an jedem Bewertungstag von der Verwaltungsstelle bewertet.

Der Wert der Anteile des Fonds ist an den Referenzindex gekoppelt (und bei die Anteilsklasse mit Währungsabsicherung an die entsprechenden Absicherungsmaßnahmen, wie unter „**Währungsabsicherungsmethode von Anteilsklassen**“ beschrieben), dessen Wertentwicklung positiv oder negativ verlaufen kann. Daher sollten Anleger beachten, dass der Wert ihrer Anlage sowohl steigen als auch fallen kann und es keine Garantie dafür gibt, dass sie ihr investiertes Kapital zurückerhalten.

Der Fonds hat keinen letzten Rückkauftag. Allerdings kann der Verwaltungsrat beschließen, den Fonds gemäß den im Prospekt aufgeführten Bedingungen und/oder der Satzung zu beenden.

Absicherung von Anteilsklassen

Die Anteilsklasse „3C – MXN Hedged“, („**Anteilsklasse mit Währungsabsicherung**“, wie nachstehend unter „Beschreibung der Anteile“ erläutert) unterliegt einer Währungsabsicherung.

Entsprechend der im Prospekt dargelegten „**Währungsabsicherungsmethode von Anteilsklassen**“ wird der Fonds sich um eine Absicherung gegen das Währungsexposure der Basiswertpapiere im Portfolio bemühen, bei denen sich die Währung von jener der Anteilsklasse mit Währungsabsicherung unterscheidet.

Anleger sollten beachten, dass die Anteilsklasse mit Währungsabsicherung das Währungsrisiko nicht vollständig eliminieren oder eine präzise Absicherung gewährleisten. Daher können Anleger ein Exposure in Bezug auf andere Währungen als jener der Anteilsklasse mit Währungsabsicherung haben.

Effizientes Portfoliomanagement und derivative Finanzinstrumente

Für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements kann der Fonds vorbehaltlich der von der Central Bank jeweils festgelegten Bedingungen und Beschränkungen sowie vorbehaltlich der Bedingungen des Prospekts und dieses Nachtrags auf übertragbare Wertpapiere bezogene Techniken und Instrumente einsetzen. Der Fonds darf Wertpapierleihgeschäfte für ein effizientes Portfoliomanagement nur unter den Bedingungen und unter Einhaltung der Grenzen tätigen, die die Central Bank festlegt.

Der Fonds darf vorbehaltlich der von der Central Bank festgelegten Bedingungen und Beschränkungen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements und wie im Prospekt beschrieben auch in FDI anlegen. Einzelheiten zu den FDI, die der Fonds einsetzen kann, finden Sie im Abschnitt „**Einsatz von Derivaten durch Fonds mit Direkter Anlagepolitik**“ im Prospekt.

Die Gesellschaft verwendet ein Risikomanagementverfahren, das die dauernde exakte Messung, Überwachung und Verwaltung der mit den FDI-Positionen des Fonds verbundenen Risiken sowie ihres Einflusses auf das gesamte Risikoprofil des Portfolios aus Vermögenswerten eines Fonds ermöglicht. Auf Verlangen wird die Gesellschaft den Anteilsinhabern ergänzende Informationen über die angewandten Risikomanagementmethoden einschließlich der angewandten quantitativen Begrenzungen und der jüngsten Entwicklungen bei den Risiko- und Renditemerkmalen der wichtigsten Anlagekategorien in Bezug auf den jeweiligen Fonds zukommen lassen.

Berechnung des Gesamt-Exposure

Der Fonds ermittelt sein Gesamt-Exposure nach dem „Commitment Approach“ und stellt auf diese Weise sicher, dass er derivative Instrumente im Rahmen der von der Central Bank vorgegebenen Beschränkungen einsetzt. Das Gesamt-Exposure wird täglich berechnet. Durch den Einsatz von FDI kann der Fonds zwar gehebelt sein; eine solche Hebelung wird jedoch nicht mehr als 100% des Nettoinventarwertes des Fonds betragen.

Anlagebeschränkungen

Für den Fonds gelten die allgemeinen Anlagebeschränkungen, die im Prospekt im Abschnitt „Anlagebeschränkungen“ beschrieben sind.

Des Weiteren legt der Fonds nicht mehr als 10% seiner Vermögenswerte in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen an, um für Anlagen durch OGAW, die der OGAW-Richtlinie unterliegen, in Betracht zu kommen.

Der Verwaltungsrat kann im Hinblick auf die Einhaltung von Rechtsvorschriften in den Rechtsordnungen, in denen Anteilsinhaber ansässig sind, weitere Anlagebeschränkungen auferlegen, die mit den Interessen der Anteilsinhaber vereinbar oder diesen förderlich sind. Solche Anlagebeschränkungen werden in einen aktualisierten Nachtrag aufgenommen.

Fremdkapitalaufnahme

Die Aufnahme von Fremdmitteln durch die Gesellschaft für Rechnung des Fonds ist auf 10% des Nettoinventarwertes des Fonds beschränkt und steht unter der Voraussetzung, dass diese Fremdmittelaufnahme

vorübergehend erfolgt. Die Vermögenswerte des Fonds können für eine solche Fremdmittelaufnahme als Sicherheit belastet werden.

Spezifische Risikowarnung

Anleger sollten beachten, dass der Fonds weder über einen Kapitalschutz noch über eine Garantie verfügt und das angelegte Kapital weder geschützt noch garantiert ist. Bei diesem Fonds müssen Anleger bereit und in der Lage sein, Verluste des eingesetzten Kapitals bis hin zum Totalverlust hinzunehmen.

Risiken in Zusammenhang mit der Währungsabsicherung

Zur Verringerung des Risikos von Schwankungen der Währung einer Anteilsklasse mit Währungsabsicherung gegenüber der Währung der Portfoliobestandteile (sofern sich diese von der Währung der jeweiligen Anteilsklasse mit Währungsabsicherung unterscheidet) werden für diese Anteilsklasse spezifische Derivatetransaktionen eingegangen, um Währungsabsicherungen für jede Anteilsklasse mit Währungsabsicherung zu erwerben. Der Ertrag der für die Anteilsklasse spezifischen Derivatetransaktionen gleicht die tatsächlichen Schwankungen zwischen der Währung der Anteilsklasse mit Währungsabsicherung und dem Währungsexposure der Wertpapiere, die den Teil des Portfolios ausmachen, der sich auf die Anteilsklasse mit Währungsabsicherung bezieht, eventuell nicht vollständig aus. Es kann keine Zusicherung gegeben werden, dass diese Absicherungsmaßnahmen ihren Zweck auch vollständig erfüllen. Währungsabsicherungsgeschäfte verringern zwar die Risiken und Verluste im Falle ungünstiger Marktbedingungen, doch können durch sie auch Gewinne verringert oder unter Umständen vollständig aufgehoben werden, die bei Marktbedingungen, die ohne diese Absicherungsmaßnahmen vorteilhaft gewesen wären, erzielt worden wären. Infolgedessen kann sich die Wertentwicklung einer Anteilsklasse mit Währungsabsicherung aufgrund der Währungsabsicherungsgeschäfte von der des Basiswertes unterscheiden.

Konzentration des Referenzindex

Der Referenzindex konzentriert sich auf Staatsanleihen, die von einer einzigen Regierung ausgegeben werden. Veränderungen der Finanzlage der Regierung, Veränderungen der die Regierung betreffenden besonderen wirtschaftlichen oder politischen Bedingungen sowie Veränderungen der allgemeinen wirtschaftlichen oder politischen Bedingungen können sich auf den Wert der von dieser Regierung begebenen Staatsanleihen auswirken. Derartige emittentenspezifische Veränderungen können sich negativ auf die Wertentwicklung des Referenzindex und des Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren und geeigneten Vermögenswerten, die vom Fonds gehalten werden, auswirken.

Anleger tragen zudem einige andere Risiken, wie im Abschnitt „Risikofaktoren“ im Prospekt beschrieben.

Profil des typischen Anlegers

Potenzielle Anleger des Fonds sollten sicherstellen, dass sie das Wesen des Fonds sowie den Umfang der Risiken, denen sie sich mit einer Anlage in den Fonds aussetzen, vollständig verstehen, und die Eignung einer Anlage in den Fonds prüfen.

Eine Anlage in den Fonds kann für Anleger geeignet sein, die über Kenntnisse und Anlageerfahrung in Bezug auf diese Art von Finanzprodukt verfügen und die Strategie und Merkmale verstehen und einschätzen können, um so eine fundierte Anlageentscheidung zu treffen. Diese verfügen unter Umständen auch über freie und verfügbare Mittel zu Anlagezwecken und sind an einem Exposure in Bezug auf die den Referenzindex bildenden Wertpapiere interessiert. Da der Nettoinventarwert je Fondsanteil Schwankungen unterliegen wird und fallen kann, sollten nur Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont eine Anlage in den Fonds in Betracht ziehen. Potenzielle Anleger müssen jedoch bereit und in der Lage sein, Verluste des eingesetzten Kapitals bis hin zum Totalverlust hinzunehmen.

Im Prospekt sind Ausführungen zur Besteuerung enthalten, die sich auf das geltende Recht und die geltende Praxis in der jeweiligen Rechtsordnung zum Datum des Prospekts beziehen. Diese Ausführungen geben lediglich einen allgemeinen Überblick für potenzielle Anleger und Anteilsinhaber und stellen keinerlei Beratung in rechtlichen und steuerrechtlichen Fragen für Anteilsinhaber und potenzielle Anleger dar. Anteilsinhaber und potenzielle Anleger sollten sich daher von ihren professionellen Beratern in Bezug auf eine Anlage in den Fonds beraten lassen, insbesondere, da sich die steuerliche Position eines Anlegers sowie die Steuersätze im Laufe der Zeit ändern können.

Ausschüttungspolitik

Der Fonds beabsichtigt nicht, Ausschüttungen vorzunehmen.

Allgemeine Informationen in Bezug auf

die Basiswährung des Fonds USD

Annahmefrist 16:30 Uhr Ortszeit Dublin am jeweiligen Transaktionstag.

Mindestfondsvolumen USD 50.000.000

Abwicklungszeitraum ist ein Zeitraum von bis zu neun Geschäftstagen nach dem Transaktionstag.¹

Wertpapierleihgeschäfte Ja

Wertpapierleihstelle Deutsche Bank AG, handelnd durch ihre Hauptniederlassung Frankfurt und ihre Niederlassungen London und New York.

Gebührenanspruch der Wertpapierleihstelle Die Wertpapierleihstelle erhält für die in Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften erbrachten Dienstleistungen eine Gebühr.

Erträge aus Wertpapierleihgeschäften Soweit der Fonds Wertpapierleihgeschäfte zur Kostenreduzierung tätigt, werden ihm letztlich 70% der daraus resultierenden Erträge zugewiesen; dem Portfoliounterverwalter und der Wertpapierleihstelle fallen jeweils 15% zu. Der Einfachheit halber erhält der Fonds zunächst 85% der auf diese Weise generierten Erträge, aus denen auch die Zuteilung an den Portfoliounterverwalter bestritten wird. In Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte handelt die Wertpapierleihstelle als Vertreter der Gesellschaft und bietet der Portfoliounterverwalter Risikoüberwachungsdienste für die Gesellschaft. Da sich die Kosten für den laufenden Betrieb des Fonds durch die Aufteilung der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften nicht erhöhen, ist diese in den nachstehend unter „Gebühren und Aufwendungen“ aufgeführten Zahlen nicht berücksichtigt.

Bedeutender Markt bezeichnet einen Bedeutenden Markt für Direkte Replikation.

Beschreibung der Anteile

	„1C“	„3C – MXN Hedged“
ISIN-Code	IE00BM97MR69	IE00BM97MV06
WKN	A2P7TP	A2P7TS
Währung	USD	MXN
Erstausgabepreis	N/A	N/A
Auflegungstermin	3. September 2020	9. Februar 2021
Mindestanlagebetrag bei Erstzeichnung	USD 50.000	MXN 1.200.000
Mindestanlagebetrag bei Folgezeichnung	USD 50.000	MXN 1.200.000
Mindestrücknahmebetrag	USD 50.000	MXN 1.200.000
Anteilsklasse mit Währungsabsicherung	Nein	Ja

¹ Wenn ein Bedeutender Markt an einem Geschäftstag während des Zeitraums zwischen dem jeweiligen Transaktionstag und dem erwarteten Abwicklungstag (einschließlich) für den Handel oder die Abwicklung geschlossen ist und/oder die Abwicklung in der Basiswährung des Fonds am erwarteten Abwicklungstag nicht möglich ist, können sich entsprechende Verschiebungen der in diesem Nachtrag angegebenen Abwicklungszeiten ergeben, vorbehaltlich der aufsichtsrechtlichen Beschränkung von Abwicklungszeiträumen auf zehn Geschäftstage ab Ende der Annahmefrist. Frühere oder spätere Zeitpunkte können von der Verwaltungsgesellschaft nach eigenem Ermessen bestimmt werden; eine entsprechende Mitteilung erfolgt auf www.Xtrackers.com.

Gebühren und Aufwendungen

	„1C“	„3C – MXN Hedged“
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	bis zu 0,01% p. a.	bis zu 0,04% p. a.
Plattformgebühr	bis zu 0,05% p. a.	bis zu 0,05% p. a.
Pauschalgebühr	bis zu 0,06% p. a.	bis zu 0,09% p. a.
Primärmarkt-Transaktionskosten	Anwendbar	Anwendbar
Transaktionskosten	Anwendbar	Anwendbar
Voraussichtlicher Tracking Error²	bis zu 1%	

Dieser Abschnitt „Gebühren und Aufwendungen“ ist zusammen mit dem Abschnitt „Gebühren und Aufwendungen“ im Prospekt zu lesen.

² Der angegebene voraussichtliche Tracking Error entspricht dem voraussichtlichen Tracking Error der nicht abgesicherten Anteilsklassen gegenüber dem Referenzindex des Fonds (der ebenfalls nicht abgesichert ist).

ALLGEMEINE ANGABEN ZUM BASISWERT

Dieser Abschnitt gibt einen Kurzüberblick über den Referenzindex. Er fasst seine wesentlichen Merkmale zusammen, stellt jedoch keine vollständige Beschreibung des Referenzindex dar. Bei Unstimmigkeiten zwischen der Zusammenfassung des Referenzindex in diesem Abschnitt und der vollständigen Beschreibung des Referenzindex ist die vollständige Beschreibung des Referenzindex maßgeblich. Informationen zu dem Referenzindex erscheinen auf der nachstehend unter „Weitere Informationen“ angegebenen Webseite. Diese Informationen können von Zeit zu Zeit Änderungen unterliegen, die im Einzelnen auf dieser Webseite aufgeführt werden.

Allgemeine Angaben zum Referenzindex

Der Referenzindex wird von FTSE Fixed Income LLC (der „**Indexverwalter**“, wobei dieser Begriff jeden Nachfolger in dieser Funktion einschließt) verwaltet.

Der Indexverwalter wendet spezifische Regeln in Bezug auf das Universum der geeigneten Staatsanleihen an, um die Schuldtitel festzulegen, die im Referenzindex enthalten sein sollen. Die spezifischen Regeln in Bezug auf die Festlegung der Wertpapiere, die zum Universum der geeigneten Staatsanleihen gehören, sehen unter anderem vor, dass die betreffenden Wertpapiere auf US-Dollar lauten, von der US-Regierung begeben werden und als fest- und variabel verzinsliche US-Schatzpapiere und Schatzwechsel eingestuft sind, die eine Restlaufzeit von einem Monat bis zu einem Jahr (bei festverzinslichen Wertpapieren) bzw. einem Monat bis zu drei Jahren (bei variabel verzinslichen Wertpapieren) aufweisen. Weitere Eignungskriterien zum Zeitpunkt dieses Nachtrags sind unter anderem: Liquiditätsanforderungen in Bezug auf das Mindestemissionsvolumen (ein öffentlich ausstehender Betrag von 5 Milliarden USD ohne die Bestände der Federal Reserve) sowie der Ausschluss bestimmter Wertpapierarten, darunter TIPS, Strips und kündbare Anleihen.

Der Referenzindex wird täglich vom Indexverwalter berechnet. Anleihen im Referenzindex werden auf Basis des Geldkurses bewertet.

Der Referenzindex wird auf Basis der Gesamrendite (Total Return) berechnet, d. h. Kuponzahlungen werden in den Referenzindex reinvestiert. Zahlungen aus Kupons und geplanten Teil- und ungeplanten vollständigen Rücknahmen werden bis zur nächsten Neugewichtung in Form von Barmitteln gehalten, die dann wieder im Referenzindex angelegt werden.

Die Zusammensetzung des Referenzindex wird jeden Monat am Monatsende neu gewichtet. Die in dem Referenzindex enthaltenen Wertpapiere werden an jedem Neugewichtungstag anhand des relativen Marktwerts jeder Emission gewichtet.

Das Basisdatum des Referenzindex ist der 28. Februar 2014.

Weitere Informationen

Weitere Informationen zum Referenzindex, einschließlich aller maßgeblichen Auswahlkriterien und Indexbestandteile, finden Sie unter <https://www.yieldbook.com/m/indexes/fund/>, weitere Informationen zum Referenzindex, einschließlich der angewandten Methodik, sind unter <https://www.yieldbook.com/m/indices/search.shtml> verfügbar.

WICHTIG

Der Xtrackers US Treasuries Ultrashort Bond UCITS ETF (der „**Fonds**“) wurde ausschließlich von der Gesellschaft entwickelt. Der Fonds ist in keiner Weise mit der London Stock Exchange Group plc und ihren Konzernunternehmen (zusammen die „**LSE-Gruppe**“) verbunden, und wird von dieser nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. FTSE Russell ist ein Handelsname bestimmter Unternehmen der LSE-Gruppe.

Alle Rechte am FTSE US Treasury Short Duration Index (der „**Index**“) liegen beim jeweiligen Unternehmen der LSE-Gruppe, dem der Index gehört. „FTSE®“ und „The Yield Book®“ sind Handelsmarken des jeweiligen Unternehmens der LSE-Gruppe und werden von allen anderen Unternehmen der LSE-Gruppe im Rahmen einer Lizenz genutzt.

Der Index wird von oder für FTSE Fixed Income, LLC oder eines ihrer verbundenen Unternehmen bzw. einen ihrer Beauftragten oder Partner berechnet. Die LSE-Gruppe übernimmt keine Haftung jeglicher Art gegenüber irgendwelchen Personen aufgrund (a) der Nutzung des Indexes, des Vertrauens darauf oder eines darin enthaltenen Fehlers oder (b) der Anlage in den Fonds oder dessen Betrieb. Die LSE-Gruppe macht keine Behauptungen, Vorhersagen, Gewährleistungen oder Zusicherungen in Bezug auf die mit dem Fonds erzielbaren Ergebnisse oder die Eignung des Index für den Zweck, zu dem er von der Gesellschaft verwendet wird.