

# db x-trackers II<sup>\*\*</sup>

*Société d'investissement à capital variable*  
*R.C.S. Luxembourg N° B-124.284*

**Ungeprüfter Halbjahresbericht  
für den Zeitraum vom 1. Januar 2016 bis 30. Juni 2016**

Deutsche Bank 

Zeichnungen auf Grundlage der Finanzberichte können nicht akzeptiert werden. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Basis des jeweils gültigen Prospekts in Verbindung mit dem zuletzt erschienenen Jahresbericht sowie dem zuletzt erschienenen Halbjahresbericht, sofern dieser nach dem Jahresbericht veröffentlicht wurde, erfolgen.

<sup>\*\*</sup> Umfasst auch synthetische ETF.

**Die Gesellschaft ist als Umbrella-Fonds strukturiert. Sie hat die Absicht, Anteile der Teilfonds in der Bundesrepublik Deutschland zu vertreiben. Der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht wurde dies gemäß § 310 des Kapitalanlagegesetzbuches ("KAGB") für die einzelnen Teilfonds der Gesellschaft angezeigt. Die Anteile der Teilfonds dürfen daher an Anleger in der Bundesrepublik Deutschland vertrieben werden.**

**Hiervon ausgenommen sind jedoch Anteile der nicht zum Vertrieb angezeigten Anteilklassen vertriebsberechtigter Teilfonds.**

**Bei den nicht zum Vertrieb angezeigten Anteilklassen handelt es sich zum 30. Juni 2016 namentlich um:**

- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF\* – Anteilsklasse 2D**
- db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN UCITS ETF\* – Anteilsklasse 1D**
- db x-trackers II HARVEST CSI CHINA SOVEREIGN BOND UCITS ETF (DR) – Anteilsklasse 2D**

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

## Inhaltsverzeichnis

|  | <u>Seite</u> |
|--|--------------|
| Organisation   | 5            |
| Informationen für in Hongkong ansässige Personen                             | 7            |
| Statistik  | 8            |
| Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016                                  | 25           |
| Anlagebestand zum 30. Juni 2016  | 42           |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF*                        | 42           |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF*                    | 49           |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF*                    | 51           |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF*                    | 53           |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF*                   | 55           |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF*                  | 57           |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF*                    | 58           |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+ UCITS ETF*                    | 60           |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*                    | 62           |
| db x-trackers II IBOXX EURO INFLATION-LINKED UCITS ETF*                      | 68           |
| db x-trackers II EONIA UCITS ETF*  | 72           |
| db x-trackers II ITRAXX® EUROPE UCITS ETF*                                   | 77           |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER UCITS ETF*                                | 78           |
| db x-trackers II ITRAXX® EUROPE SHORT DAILY UCITS ETF*                       | 79           |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER SHORT DAILY UCITS ETF*                    | 82           |
| db x-trackers II EMERGING MARKETS LIQUID EUROBOND UCITS ETF*                 | 84           |
| db x-trackers II SHORT IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE DAILY UCITS ETF*          | 87           |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF*                            | 89           |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS UCITS ETF*                                    | 90           |
| db x-trackers II IBOXX UK GILT INFLATION-LINKED UCITS ETF*                   | 91           |
| db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE RATE UCITS ETF*                         | 92           |
| db x-trackers II STERLING CASH UCITS ETF*                                    | 96           |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF*                                 | 97           |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF INDONESIA GOVERNMENT UCITS ETF*            | 101          |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF SINGAPORE GOVERNMENT UCITS ETF*            | 102          |
| db x-trackers II SINGAPORE DOLLAR CASH UCITS ETF*                            | 103          |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS 1-5 UCITS ETF*                                | 104          |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR)                          | 105          |
| db x-trackers II UK GILTS SHORT DAILY UCITS ETF*                             | 109          |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR)         | 112          |
| db x-trackers II US TREASURIES SHORT DAILY UCITS ETF*                        | 114          |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF (DR)                      | 115          |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF*                       | 117          |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF*                                    | 123          |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 1-3 UCITS ETF*                                | 124          |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF KOREA GOVERNMENT UCITS ETF*                | 125          |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF*            | 126          |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF*        | 128          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA UCITS ETF*                    | 131          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF*             | 133          |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF*                           | 139          |
| db x-trackers II AUSTRALIA SSA BONDS UCITS ETF*                              | 140          |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED 1-3 UCITS ETF*                        | 141          |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER 2X SHORT DAILY UCITS ETF*                 | 142          |
| db x-trackers II IBOXX GBP LIQUID CORPORATE UCITS ETF*                       | 144          |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BOT UCITS ETF*                         | 145          |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY AGGREGATE UCITS ETF*                   | 147          |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BTP UCITS ETF*                         | 148          |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 3-5 UCITS ETF*                                | 149          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA 1-3 UCITS ETF*                | 150          |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 7-10 UCITS ETF*                               | 151          |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID COVERED UCITS ETF*                         | 152          |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 1-3 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | 154          |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 3-5 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | 155          |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

|  |     |
|--|-----|
| db x-trackers II CANADIAN DOLLAR CASH UCITS ETF*                     | 156 |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF* | 157 |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN UCITS ETF*                              | 161 |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN 1-3 UCITS ETF*                          | 162 |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN UCITS ETF*             | 163 |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN SHORT DAILY UCITS ETF* | 164 |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*           | 165 |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF*                | 170 |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND SHORT DAILY UCITS ETF*    | 176 |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF*            | 177 |
| db x-trackers II HARVEST CSI CHINA SOVEREIGN BOND UCITS ETF (DR)     | 182 |
| Anhang zum Halbjahresabschluss                                       | 183 |
| Informationen für Anteilsinhaber                                     | 202 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Organisation

|  |
|--|
| <p><b>Eingetragener Sitz</b><br/>db x-trackers II**<br/>49 avenue J.F. Kennedy<br/>L-1855 Luxemburg<br/>Großherzogtum Luxemburg</p>  |
| <p><b>Verwaltungsrat</b><br/><b>Werner Burg</b> (Vorsitzender des Verwaltungsrats)<br/>Mitglied der Geschäftsleitung, Deutsche Bank Luxembourg S.A., 2, boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg.<br/>General Manager der Deutsche Bank AG, Niederlassung Luxemburg 2, boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg.<br/><b>Klaus-Michael Vogel</b><br/>Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied, c/o Deutsche Asset Management S.A., 2, boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg.<br/><b>Jacques Elvinger</b><br/>Partner, Elvinger Hoss Prussen, 2, place Winston Churchill, L-1340 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg.<br/><b>Manooj Mistry</b><br/>Leiter der Exchange Traded Products and Institutional Passive, Deutsche Bank AG, London Branch, Winchester House, 1, Great Winchester Street, London EC2N 2DB, Vereinigtes Königreich.<br/><b>Ben O'Bryan</b><br/>Leiter der weltweiten Produktplattform für alternative OGAW, Deutsche Bank AG, London Branch, Winchester House, 1, Great Winchester Street, London EC2N 2DB, Vereinigtes Königreich.<br/><b>Philippe Ah-Sun</b><br/>Geschäftsführer für börsennotierte Fonds (ETF) und systematische OGAW, Deutsche Bank AG, London Branch, Winchester House, 1, Great Winchester Street, London EC2N 2DB, Vereinigtes Königreich</p> |
| <p><b>Verwahrstelle</b><br/>State Street Bank Luxembourg S.C.A.<br/>49 avenue J.F. Kennedy<br/>L-1855 Luxemburg<br/>Großherzogtum Luxemburg</p>  |
| <p><b>Verwaltungsgesellschaft</b><br/>Deutsche Asset Management S.A. (zuvor Deutsche Asset &amp; Wealth Management Investment S.A., umbenannt am 17. März 2016)<br/>2 boulevard Konrad Adenauer<br/>L-1115 Luxemburg<br/>Großherzogtum Luxemburg</p>   |
| <p><b>Verwaltungs-, Zahl-, Domiziliar- und Börsenzulassungsstelle</b><br/>State Street Bank Luxembourg S.C.A.<br/>49 avenue J.F. Kennedy<br/>L-1855 Luxemburg<br/>Großherzogtum Luxemburg</p>  |
| <p><b>Register- und Transferstelle</b><br/>State Street Bank Luxembourg S.C.A.<br/>49 avenue J.F. Kennedy<br/>L-1855 Luxemburg<br/>Großherzogtum Luxemburg</p>   |

Organisation (Fortsetzung)

|  |
|--|
| <p><b>Anlageverwalter / Portfoliounterverwalter für bestimmte Teilfonds (siehe Erläuterung 9)</b><br/>State Street Global Advisors Limited<br/>20 Churchill Place, Canary Wharf<br/>London E14 5HJ<br/>Vereinigtes Königreich</p> <p>Deutsche Asset Management (UK) Limited<br/>Winchester House<br/>1 Great Winchester Street<br/>London, EC2N 2DB<br/>Vereinigtes Königreich</p> <p>Deutsche Asset Management Investment GmbH<br/>Mainzer Landstraße 11-17<br/>60329 Frankfurt am Main<br/>Deutschland</p> <p>Harvest Global Investments Limited<br/>31/F One Exchange Square<br/>8 Connaught Place, Central Hong Kong<br/>Hong Kong</p> |
| <p><b>Unabhängiger Abschlussprüfer der Gesellschaft (Réviseur d'Entreprises Agréé)</b><br/>Ernst &amp; Young S.A.<br/>35E avenue J.F. Kennedy<br/>L-1855 Luxemburg<br/>Großherzogtum Luxemburg</p>   |
| <p><b>Rechtsberater der Gesellschaft</b><br/>Elvinger Hoss Prussen<br/>2 place Winston Churchill<br/>L-1340 Luxemburg<br/>Großherzogtum Luxemburg</p>  |
| <p><b>Repräsentant in Hongkong</b><br/>RBC Investor Services Trust Hong Kong Limited<br/>51st floor, Central Plaza<br/>18 Harbour Road<br/>Wanchai, Hongkong</p>   |

Alle hierin verwendeten Begriffe haben die ihnen im aktuellen Prospekt von db x-trackers II\*\* (der „Prospekt“) zugewiesene Bedeutung.

db x-trackers II\*\*

Informationen für in Hongkong ansässige Personen

### **In Hongkong zugelassener Teilfonds**

Zum 30. Juni 2016 war nur der folgende Teilfonds von db x-trackers II\*\* (der „Zugelassene Teilfonds“) von der Securities and Futures Commission in Hongkong (die „SFC“) zugelassen:

| <b>Teilfonds</b>                                   | <b>In Hongkong verfügbare Anteilsklasse</b> |
|--|---|
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF* | 4C  |

Mit Ausnahme des Zugelassenen Teilfonds sind keine Teilfonds von db x-trackers II\*\* zum öffentlichen Verkauf in Hongkong zugelassen, noch sind sie für in Hongkong ansässige Personen verfügbar.

### **Bestätigung der Verwahrstelle**

Gemäß Abschnitt 4.5(f) des von der SFC herausgegebenen Code on Unit Trusts and Mutual Funds (der „SFC-Code“) bestätigt die State Street Bank Luxembourg S.C.A. in ihrer Funktion als Verwahrstelle für db x-trackers II\*\* hiermit, dass sie nach bestem Wissen und Gewissen gemäß den Anforderungen an eine Verwahrstelle im Einklang mit den anwendbaren luxemburgischen Gesetzen und Vorschriften und der Verwahrstellenvereinbarung mit db x-trackers II\*\* der Ansicht ist, dass die Verwaltungsgesellschaft von db x-trackers II\*\* während des ersten Geschäftshalbjahres 2016 db x-trackers II\*\* in allen wesentlichen Belangen gemäß den Bestimmungen der Satzung von db x-trackers II\*\* verwaltet hat.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik

|                                    | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 1-3<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 3-5<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 5-7<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|---|---|---|---|
|                                    | EUR   | EUR   | EUR   | EUR   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |   |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |   |   |
| 1C                                 | 1.650.984.789   | 362.957.191   | 459.530.343   | 279.537.364   |
| 1D                                 | 45.639.338 <sup>(1)</sup>   | 3.806.770   | 16.348.761  | –   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | 1.407.778.507   | 407.710.892   | 540.411.608   | 289.152.293   |
| 1D                                 | 34.787.454 <sup>(1)</sup>   | 3.819.716   | 18.104.776  | –   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | 1.329.469.475   | 364.970.254   | 456.667.736   | 282.783.169   |
| 1D                                 | 25.620.207 <sup>(1)</sup>   | 5.756.977   | 19.898.433  | –   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |   |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |   |   |
| 1C                                 | 234,89  | 170,04  | 203,03  | 235,93  |
| 1D                                 | 206,02 <sup>(1)</sup>   | 160,90  | 192,46  | –   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | 222,44  | 169,68  | 200,06  | 228,77  |
| 1D                                 | 197,27 <sup>(1)</sup>   | 161,61  | 190,82  | –   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | 219,20  | 168,69  | 197,46  | 224,93  |
| 1D                                 | 195,30 <sup>(1)</sup>   | 161,71  | 189,90  | –   |

<sup>(1)</sup> Diese Anteilsklasse wurde bis einschließlich 17. Dezember 2015 mit „4%-D“ bezeichnet.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



## db x-trackers II\*\*

## Statistik (Fortsetzung)

|                                    | <b>db x-trackers II<br/>IBOXX<br/>SOVEREIGNS<br/>EUROZONE 7-10<br/>UCITS ETF*</b> | <b>db x-trackers II<br/>IBOXX<br/>SOVEREIGNS<br/>EUROZONE 10-15<br/>UCITS ETF*</b> | <b>db x-trackers II<br/>IBOXX<br/>SOVEREIGNS<br/>EUROZONE 15+<br/>UCITS ETF*</b> | <b>db x-trackers II<br/>IBOXX<br/>SOVEREIGNS<br/>EUROZONE 25+<br/>UCITS ETF*</b> |
|------------------------------------|---|--|--|--|
|                                    | <b>EUR</b>  | <b>EUR</b>   | <b>EUR</b>   | <b>EUR</b>   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |  |  |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |  |  |  |
| 1C                                 | 155.370.270   | 26.243.315   | 44.735.146   | 56.414.246   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |  |  |  |
| 1C                                 | 201.599.039   | 35.985.363   | 42.670.542   | 29.145.232   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |  |  |  |
| 1C                                 | 160.434.892   | 136.163.232  | 96.389.447   | 33.436.728   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |  |  |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |  |  |  |
| 1C                                 | 260,25  | 284,08   | 352,13   | 374,33   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |  |  |  |
| 1C                                 | 246,67  | 262,13   | 300,66   | 304,75   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |  |  |  |
| 1C                                 | 242,64  | 256,13   | 295,14   | 302,72   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>IBOXX GLOBAL<br>INFLATION-LINKED<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX EURO<br>INFLATION-LINKED<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>EONIA UCITS ETF* | db x-trackers II<br>ITRAXX® EUROPE<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|--|--|--------------------------------------|--|
|                                    | EUR  | EUR  | EUR                                  | EUR  |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |  |  |                                      |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |  |                                      |  |
| 1C                                 | 534.289.555  | 375.736.011  | 570.310.456                          | 34.395.900                                       |
| 1D                                 | 10.828.240   | –  | 8.518.583                            | –  |
| maxblue Cash ETF                   | –  | –  | –                                    | –  |
| 2C                                 | 81.667.605 <sup>(1)</sup>  | –  | 37.879.743                           | –  |
| 3C                                 | –  | –  | –                                    | –  |
| 3D                                 | 16.622.299 <sup>(2)</sup>  | –  | –                                    | –  |
| 4D                                 | 17.937.236 <sup>(3) (4)</sup>                                      | –  | –                                    | –  |
| 5C                                 | 18.698.267   | –  | –                                    | –  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |  |                                      |  |
| 1C                                 | 444.479.650  | 317.228.178  | 605.304.593                          | 24.027.446                                       |
| 1D                                 | 6.333.282  | –  | 14.135.251                           | –  |
| maxblue Cash ETF                   | –  | –  | –                                    | –  |
| 2C                                 | 74.133.129 <sup>(1)</sup>  | –  | 47.055.449                           | –  |
| 3C                                 | –  | –  | –                                    | –  |
| 3D                                 | 10.338.677 <sup>(2)</sup>  | –  | –                                    | –  |
| 4D                                 | 12.020.926 <sup>(3) (4)</sup>                                      | –  | –                                    | –  |
| 5C                                 | 8.902.113  | –  | –                                    | –  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |  |                                      |  |
| 1C                                 | 440.238.472  | 137.796.913  | 356.825.731                          | 26.887.023                                       |
| 1D                                 | 8.531.927  | –  | 12.808.915                           | –  |
| maxblue Cash ETF                   | –  | –  | 846.090                              | –  |
| 2C                                 | 59.531.542 <sup>(1)</sup>  | –  | 206.772                              | –  |
| 3C                                 | –  | –  | 5.646.442                            | –  |
| 3D                                 | 5.644.972 <sup>(2)</sup>   | –  | –                                    | –  |
| 4D                                 | 11.244.369 <sup>(3) (4)</sup>                                      | –  | –                                    | –  |
| 5C                                 | 3.931.738  | –  | –                                    | –  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |  |  |                                      |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |  |                                      |  |
| 1C                                 | 225,45   | 214,15   | 139,12                               | 116,11   |
| 1D                                 | 211,80   | –  | 130,23                               | –  |
| maxblue Cash ETF                   | –  | –  | –                                    | –  |
| 2C                                 | 23,61 <sup>(1)</sup>   | –  | 140,00                               | –  |
| 3C                                 | –  | –  | –                                    | –  |
| 3D                                 | 24,54 <sup>(2)</sup>   | –  | –                                    | –  |
| 4D                                 | 109,42 <sup>(3) (4)</sup>  | –  | –                                    | –  |
| 5C                                 | 21,34  | –  | –                                    | –  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |  |                                      |  |
| 1C                                 | 208,46   | 207,18   | 139,43                               | 116,61   |
| 1D                                 | 203,74   | –  | 134,21                               | –  |
| maxblue Cash ETF                   | –  | –  | –                                    | –  |
| 2C                                 | 21,71 <sup>(1)</sup>   | –  | 140,25                               | –  |
| 3C                                 | –  | –  | –                                    | –  |
| 3D                                 | 23,41 <sup>(2)</sup>   | –  | –                                    | –  |
| 4D                                 | 105,65 <sup>(3) (4)</sup>  | –  | –                                    | –  |
| 5C                                 | 20,44  | –  | –                                    | –  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |  |                                      |  |
| 1C                                 | 211,06   | 203,55   | 139,76                               | 116,57   |
| 1D                                 | 207,97   | –  | 134,53                               | –  |
| maxblue Cash ETF                   | –  | –  | 34,63                                | –  |
| 2C                                 | 21,95 <sup>(1)</sup>   | –  | 140,47                               | –  |
| 3C                                 | –  | –  | 140,75                               | –  |
| 3D                                 | 23,91 <sup>(2)</sup>   | –  | –                                    | –  |
| 4D                                 | 108,57 <sup>(3) (4)</sup>  | –  | –                                    | –  |
| 5C                                 | 19,37  | –  | –                                    | –  |

<sup>(1)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf USD.

<sup>(2)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf GBP.

<sup>(3)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf CHF.

<sup>(4)</sup>Diese Anteilsklasse wurde bis einschließlich 17. Dezember 2015 mit „4C“ bezeichnet.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>ITRAXX®<br>CROSSOVER<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>ITRAXX® EUROPE<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>ITRAXX®<br>CROSSOVER<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>EMERGING<br>MARKETS LIQUID<br>EUROBOND<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|--|---|---|--|
|                                    | EUR  | EUR   | EUR   | EUR  |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |  |   |   |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |   |   |  |
| 1C                                 | 343.169.070  | 3.575.332   | 46.716.795  | 436.072.459  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |   |   |  |
| 1C                                 | 213.088.869  | 3.572.685   | 36.332.421  | 247.960.649  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |   |   |  |
| 1C                                 | 124.946.402  | 13.784.436  | 28.409.425  | 334.986.983  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |  |   |   |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |   |   |  |
| 1C                                 | 172,32   | 96,10   | 51,31   | 318,66   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |   |   |  |
| 1C                                 | 177,45   | 96,38   | 50,84   | 297,30   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |   |   |  |
| 1C                                 | 173,05   | 97,37   | 53,80   | 297,02   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>SHORT IBOXX €<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>DAILY UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX GERMANY<br>COVERED UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX £ GILTS<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX UK GILT<br>INFLATION-<br>LINKED UCITS<br>ETF* |
|------------------------------------|--|--|---|---|
|                                    | EUR  | EUR  | GBP   | GBP   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |  |  |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |  |   |   |
| 1C                                 | 167.599.764  | 161.247.537  | –   | –   |
| 1D                                 | –  | 2.301.411  | 5.078.980                                       | 6.197.297   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |  |   |   |
| 1C                                 | 162.864.744  | 171.507.022  | –   | –   |
| 1D                                 | –  | 2.302.261  | 4.572.455                                       | 5.364.340   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |  |   |   |
| 1C                                 | 132.726.422  | 180.808.592  | –   | –   |
| 1D                                 | –  | 5.001.688  | 6.943.615                                       | 4.233.739   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |  |  |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |  |   |   |
| 1C                                 | 77,45  | 197,10   | –   | –   |
| 1D                                 | –  | 191,15   | 260,98  | 276,46  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |  |   |   |
| 1C                                 | 82,36  | 193,27   | –   | –   |
| 1D                                 | –  | 191,38   | 235,20  | 239,59  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |  |   |   |
| 1C                                 | 84,53  | 193,19   | –   | –   |
| 1D                                 | –  | 192,34   | 237,25  | 244,85  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

## Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>FED FUNDS<br>EFFECTIVE RATE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>STERLING CASH<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>GLOBAL<br>SOVEREIGN<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MARKIT IBOXX<br>ABF INDONESIA<br>GOVERNMENT<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|---|---|---|---|
|                                    | USD   | GBP   | EUR   | USD   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |   |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |   |   |
| 1C                                 | 654.607.003   | –   | 408.863.841   | 5.087.575   |
| 1D                                 | –   | 59.500.516                                      | 164.834.176   | –   |
| 2D                                 | –   | –   | 31.782.809 <sup>(1)</sup>                             | –   |
| 4C                                 | –   | –   | 134.263.609 <sup>(2)</sup>                            | –   |
| 5C                                 | –   | –   | 25.891.312  | –   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | 558.797.885   | –   | 361.469.673   | 4.316.989   |
| 1D                                 | –   | 64.700.657                                      | 142.822.234   | –   |
| 2D                                 | –   | –   | 14.113.946 <sup>(1)</sup>                             | –   |
| 4C                                 | –   | –   | 114.696.052 <sup>(2)</sup>                            | –   |
| 5C                                 | –   | –   | 6.651.817   | –   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | 616.863.952   | –   | 257.115.059   | 4.708.273   |
| 1D                                 | –   | 73.106.972                                      | 70.305.738  | –   |
| 2D                                 | –   | –   | 1.483.618 <sup>(1)</sup>                              | –   |
| 4C                                 | –   | –   | 1.640.274 <sup>(2)</sup>                              | –   |
| 5C                                 | –   | –   | 2.120.265   | –   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |   |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |   |   |
| 1C                                 | 170,67  | –   | 234,52  | 10,74   |
| 1D                                 | –   | 183,54  | 222,91  | –   |
| 2D                                 | –   | –   | 27,56 <sup>(1)</sup>                                  | –   |
| 4C                                 | –   | –   | 183,79 <sup>(2)</sup>                                 | –   |
| 5C                                 | –   | –   | 248,72  | –   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | 170,48  | –   | 221,03  | 9,13  |
| 1D                                 | –   | 185,43  | 212,02  | –   |
| 2D                                 | –   | –   | 26,01 <sup>(1)</sup>                                  | –   |
| 4C                                 | –   | –   | 173,82 <sup>(2)</sup>                                 | –   |
| 5C                                 | –   | –   | 228,90  | –   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | 170,51  | –   | 219,38  | 10,00   |
| 1D                                 | –   | 186,32  | 211,90  | –   |
| 2D                                 | –   | –   | 25,83 <sup>(1)</sup>                                  | –   |
| 4C                                 | –   | –   | 174,57 <sup>(2)</sup>                                 | –   |
| 5C                                 | –   | –   | 211,58  | –   |

<sup>(1)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf GBP.<sup>(2)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf CHF.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>MARKIT IBOXX<br>ABF SINGAPORE<br>GOVERNMENT<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>SINGAPORE<br>DOLLAR CASH<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX £ GILTS 1-5<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX \$<br>TREASURIES<br>UCITS ETF (DR) <sup>(1)</sup> |
|------------------------------------|---|--|---|---|
|                                    | SGD   | SGD  | GBP   | USD   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |  |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |  |   |   |
| 1C                                 | 42.044.571  | 1.158.805  | –   | –   |
| 1D                                 | –   | –  | 5.892.489   | 174.324.111   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |  |   |   |
| 1C                                 | 34.971.581  | 1.157.612  | –   | –   |
| 1D                                 | –   | –  | 5.780.181   | 92.096.036  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |  |   |   |
| 1C                                 | 21.705.426  | 7.592.175  | –   | –   |
| 1D                                 | –   | –  | 3.274.655   | 28.488.454  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |  |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |  |   |   |
| 1C                                 | 137,28  | 107,53   | –   | –   |
| 1D                                 | –   | –  | 256,02  | 222,32  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |  |   |   |
| 1C                                 | 130,97  | 107,46   | –   | –   |
| 1D                                 | –   | –  | 251,40  | 214,71  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |  |   |   |
| 1C                                 | 130,25  | 107,36   | –   | –   |
| 1D                                 | –   | –  | 252,58  | 213,32  |

<sup>(1)</sup>Dies war bis 21. März 2016 ein synthetischer ETF.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>UK GILTS SHORT<br>DAILY UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX \$<br>TREASURIES<br>INFLATION-<br>LINKED UCITS<br>ETF (DR) <sup>(1)</sup> | db x-trackers II<br>US TREASURIES<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX \$<br>TREASURIES 1-3<br>UCITS ETF (DR) <sup>(1)</sup> |
|------------------------------------|---|---|--|---|
|                                    | GBP   | USD   | USD  | USD   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |   |  |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |  |   |
| 1C                                 | 11.536.086  | –   | 4.893.454  | –   |
| 1D                                 | –   | 20.726.604 <sup>(2)</sup>   | –  | 53.136.482 <sup>(2)</sup>   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | 9.073.917   | –   | 10.180.318   | –   |
| 1D                                 | –   | 8.745.058 <sup>(2)</sup>  | –  | 55.774.396 <sup>(2)</sup>   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | 11.861.987  | –   | 12.409.925   | –   |
| 1D                                 | –   | 10.808.508 <sup>(2)</sup>   | –  | 9.743.917 <sup>(2)</sup>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |   |  |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |  |   |
| 1C                                 | 86,10   | –   | 79,06  | –   |
| 1D                                 | –   | 285,14 <sup>(2)</sup>   | –  | 169,27 <sup>(2)</sup>   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | 96,67   | –   | 83,59  | –   |
| 1D                                 | –   | 267,66 <sup>(2)</sup>   | –  | 167,10 <sup>(2)</sup>   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | 97,58   | –   | 84,78  | –   |
| 1D                                 | –   | 272,85 <sup>(2)</sup>   | –  | 166,45 <sup>(2)</sup>   |

<sup>(1)</sup>Dies war bis 21. März 2016 ein synthetischer ETF.

<sup>(2)</sup>Diese Anteilsklasse wurde bis einschließlich 20. März 2016 mit „1C“ bezeichnet.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

## Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>IBOXX EUR<br>LIQUID<br>CORPORATE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX GERMANY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX GERMANY<br>1-3 UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MARKIT IBOXX<br>ABF KOREA<br>GOVERNMENT<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|--|---|---|---|
|                                    | EUR  | EUR   | EUR   | USD   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |  |   |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |   |   |   |
| 1C                                 | 238.980.258  | 6.527.483 <sup>(1)</sup>                        | –   | 17.977.424  |
| 1D                                 | –  | 83.531.957                                      | 54.856.713  | –   |
| 2C                                 | 27.014.991   | –   | –   | –   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |   |   |   |
| 1C                                 | 201.429.532  | 7.065.181 <sup>(1)</sup>                        | –   | 6.130.938   |
| 1D                                 | –  | 80.619.408                                      | 92.202.373  | –   |
| 2C                                 | 11.004.552   | –   | –   | –   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |   |   |   |
| 1C                                 | 230.079.617  | 4.971.109 <sup>(1)</sup>                        | –   | 10.782.189  |
| 1D                                 | –  | 132.272.052                                     | 47.704.253  | –   |
| 2C                                 | 1.860.223  | –   | –   | –   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |  |   |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |   |   |   |
| 1C                                 | 149,28   | 203,10 <sup>(1)</sup>                           | –   | 159,05  |
| 1D                                 | –  | 208,57  | 148,95  | –   |
| 2C                                 | 114,38   | –   | –   | –   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |   |   |   |
| 1C                                 | 144,97   | 190,37 <sup>(1)</sup>                           | –   | 149,61  |
| 1D                                 | –  | 196,57  | 149,26  | –   |
| 2C                                 | 114,53   | –   | –   | –   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |   |   |   |
| 1C                                 | 145,83   | 190,61 <sup>(1)</sup>                           | –   | 152,24  |
| 1D                                 | –  | 197,66  | 149,94  | –   |
| 2C                                 | 116,13   | –   | –   | –   |

<sup>(1)</sup> Diese Anteilsklasse wurde bis einschließlich 17. Dezember 2015 mit „4%-D“ bezeichnet.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



## db x-trackers II\*\*

## Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>IBOXX EUR<br>LIQUID<br>CORPORATE<br>FINANCIALS<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX EUR<br>LIQUID<br>CORPORATE<br>NON-FINANCIALS<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE AAA<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>YIELD PLUS<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|--|--|---|---|
|                                    | EUR  | EUR  | EUR   | EUR   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |  |  |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |  |   |   |
| 1C                                 | 14.368.931   | 55.120.550   | 124.655.006   | 1.572.277.505   |
| 1D                                 | –  | –  | 76.705.649  | 155.753.947   |
| 2C                                 | 800.808  | 2.614.417  | –   | 104.587.120   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |  |   |   |
| 1C                                 | 14.171.262   | 32.057.326   | 113.503.357   | 2.203.281.023   |
| 1D                                 | –  | –  | 63.789.308  | 105.081.367   |
| 2C                                 | 809.617  | 340.146  | –   | 88.404.117  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |  |   |   |
| 1C                                 | 14.839.534   | 27.144.573   | 81.832.570  | 1.703.177.359   |
| 1D                                 | –  | –  | 51.597.446  | 26.846.020  |
| 2C                                 | 117.340  | 231.330  | –   | 5.192.444   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |  |  |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |  |   |   |
| 1C                                 | 147,64   | 149,40   | 230,59  | 173,66  |
| 1D                                 | –  | –  | 225,14  | 167,59  |
| 2C                                 | 113,96   | 113,56   | –   | 113,20  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |  |   |   |
| 1C                                 | 145,75   | 143,29   | 216,16  | 166,54  |
| 1D                                 | –  | –  | 212,34  | 163,20  |
| 2C                                 | 115,35   | 112,78   | –   | 114,46  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |  |   |   |
| 1C                                 | 145,52   | 144,95   | 215,70  | 161,79  |
| 1D                                 | –  | –  | 213,09  | 159,48  |
| 2C                                 | 116,06   | 115,03   | –   | 112,49  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>AUSTRALIAN<br>DOLLAR CASH<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>AUSTRALIA SSA<br>BONDS UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX GERMANY<br>COVERED 1-3<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>ITRAXX®<br>CROSSOVER 2X<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|---|--|--|--|
|                                    | AUD   | AUD  | EUR  | EUR  |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |  |  |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |  |  |  |
| 1C                                 | 29.737.030  | 42.200.891   | 7.506.077  | 20.238.037   |
| 2C                                 | 448.588   | –  | –  | –  |
| 3C                                 | 448.588   | –  | –  | –  |
| 4C                                 | 1.346.283   | –  | –  | –  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |  |  |  |
| 1C                                 | 28.134.089  | 49.467.642   | 9.196.560  | 4.485.536  |
| 2C                                 | 2.219.326   | –  | –  | –  |
| 3C                                 | 2.219.326   | –  | –  | –  |
| 4C                                 | 1.334.773   | –  | –  | –  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |  |  |  |
| 1C                                 | 35.903.249  | 34.525.477   | 21.175.323   | 3.879.401  |
| 2C                                 | 2.171.292   | –  | –  | –  |
| 3C                                 | 2.171.292   | –  | –  | –  |
| 4C                                 | 1.305.880   | –  | –  | –  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |  |  |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |  |  |  |
| 1C                                 | 223,73  | 222,07   | 171,96   | 22,39  |
| 2C                                 | 223,73  | –  | –  | –  |
| 3C                                 | 223,73  | –  | –  | –  |
| 4C                                 | 22,39   | –  | –  | –  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |  |  |  |
| 1C                                 | 221,82  | 210,72   | 171,56   | 22,04  |
| 2C                                 | 221,82  | –  | –  | –  |
| 3C                                 | 221,82  | –  | –  | –  |
| 4C                                 | 22,20   | –  | –  | –  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |  |  |  |
| 1C                                 | 217,02  | 205,72   | 171,55   | 24,76  |
| 2C                                 | 217,02  | –  | –  | –  |
| 3C                                 | 217,02  | –  | –  | –  |
| 4C                                 | 21,72   | –  | –  | –  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>IBOXX GBP<br>LIQUID<br>CORPORATE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MTS EX-BANK OF<br>ITALY BOT UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>MTS EX-BANK OF<br>ITALY<br>AGGREGATE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MTS EX-BANK OF<br>ITALY BTP UCITS<br>ETF* |
|------------------------------------|--|---|--|---|
|                                    | GBP  | EUR   | EUR  | EUR   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |  |   |  |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |   |  |   |
| 1C                                 | –  | 179.321.521   | –  | –   |
| 1D                                 | 3.310.218  | –   | 74.294.584   | 18.171.793  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |   |  |   |
| 1C                                 | –  | 249.114.102   | –  | –   |
| 1D                                 | 9.140.674  | –   | 72.937.340   | 35.046.004  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |   |  |   |
| 1C                                 | –  | 154.545.453   | –  | –   |
| 1D                                 | 8.300.488  | –   | 134.461.536  | 15.793.094  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |  |   |  |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |   |  |   |
| 1C                                 | –  | 31,81   | –  | –   |
| 1D                                 | 162,94   | –   | 51,92  | 65,23   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |   |  |   |
| 1C                                 | –  | 31,83   | –  | –   |
| 1D                                 | 151,67   | –   | 51,58  | 64,54   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |   |  |   |
| 1C                                 | –  | 31,82   | –  | –   |
| 1D                                 | 153,26   | –   | 50,22  | 62,55   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

## Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>IBOXX GERMANY<br>3-5 UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE AAA<br>1-3 UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX GERMANY<br>7-10 UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX EUR<br>LIQUID COVERED<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|---|---|--|---|
|                                    | EUR   | EUR   | EUR  | EUR   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |   |  |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |  |   |
| 1C                                 | –   | 2.955.394   | –  | 54.982.410  |
| 1D                                 | 2.605.477   | –   | 3.041.030  | –   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | –   | 4.566.640   | –  | 27.935.630  |
| 1D                                 | 4.395.749   | –   | 6.374.615  | –   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | –   | 3.744.739   | –  | 71.690.258  |
| 1D                                 | 746.727   | –   | 1.897.496  | –   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |   |  |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |  |   |
| 1C                                 | –   | 162,57  | –  | 157,04  |
| 1D                                 | 184,62  | –   | 247,36   | –   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | –   | 162,17  | –  | 151,07  |
| 1D                                 | 182,44  | –   | 234,01   | –   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | –   | 161,94  | –  | 151,19  |
| 1D                                 | 182,93  | –   | 233,83   | –   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

## Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>MTS ITALY<br>AGGREGATE 1-3<br>YEARS - EX-BANK<br>OF ITALY UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>MTS ITALY<br>AGGREGATE 3-5<br>YEARS - EX-BANK<br>OF ITALY UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>CANADIAN<br>DOLLAR CASH<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>YIELD PLUS 1-3<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|---|---|---|---|
|                                    | EUR   | EUR   | CAD   | EUR   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |   |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |   |   |
| 1C                                 | –   | –   | 27.665.282  | 807.718.417   |
| 1D                                 | 4.800.533   | 4.038.207   | –   | 31.338.858  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | –   | –   | 27.592.823  | 1.295.355.564   |
| 1D                                 | 4.857.292   | 6.954.009   | –   | 25.939.348  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | –   | –   | 24.989.946  | 941.282.885   |
| 1D                                 | 26.449.942  | 3.165.963   | –   | 39.591.649  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |   |   |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |   |   |
| 1C                                 | –   | –   | 162,51  | 142,24  |
| 1D                                 | 46,13   | 53,29   | –   | 138,08  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | –   | –   | 162,24  | 141,93  |
| 1D                                 | 46,71   | 53,22   | –   | 138,86  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |   |   |
| 1C                                 | –   | –   | 161,49  | 140,47  |
| 1D                                 | 46,52   | 52,30   | –   | 138,20  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>IBOXX SPAIN<br>UCITS ETF <sup>*</sup> | db x-trackers II<br>IBOXX SPAIN 1-3<br>UCITS ETF <sup>*</sup> | db x-trackers II<br>MARKIT IBOXX<br>JAPAN<br>SOVEREIGN<br>UCITS ETF <sup>*</sup> | db x-trackers II<br>MARKIT IBOXX<br>JAPAN<br>SOVEREIGN<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF <sup>*</sup> |
|------------------------------------|---|---|--|---|
|                                    | EUR   | EUR   | JPY  | JPY   |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |   |   |  |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |  |   |
| 1C                                 | 1.045.001   | 5.983.953   | 6.501.783.861  | 739.663.025   |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | 3.447.225   | 9.702.941   | 2.247.465.958  | 795.724.315   |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | 14.677.910  | 15.067.744  | 926.314.129  | 807.760.029   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |   |   |  |   |
| <b>30. Juni 2016</b>               |   |   |  |   |
| 1C                                 | 24,48   | 18,83   | 1.431,41   | 666,45  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | 23,36   | 18,75   | 1.334,01   | 718,79  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |   |   |  |   |
| 1C                                 | 23,06   | 18,57   | 1.320,37   | 731,51  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

## Statistik (Fortsetzung)

|                                    | db x-trackers II<br>BARCLAYS<br>GLOBAL<br>AGGREGATE<br>BOND UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX EUR HIGH<br>YIELD BOND<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX EUR HIGH<br>YIELD BOND<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX EUR HIGH<br>YIELD BOND 1-3<br>UCITS ETF* |
|------------------------------------|--|--|---|--|
|                                    | USD  | EUR  | EUR   | EUR  |
| <b>Nettoinventarwert insgesamt</b> |  |  |   |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |  |   |  |
| 1C                                 | –  | –  | 3.405.307   | –  |
| 1D                                 | 66.985.216 <sup>(1)</sup>  | 194.591.456 <sup>(1)</sup>                                     | –   | 69.280.169 <sup>(1)</sup>  |
| 2C                                 | 126.096.411  | –  | –   | –  |
| 3D                                 | 5.419.723 <sup>(2)</sup>   | –  | –   | –  |
| 4C                                 | 278.009.056 <sup>(3)</sup>   | –  | –   | –  |
| 5C                                 | 436.110.187 <sup>(4)</sup>   | –  | –   | –  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |  |   |  |
| 1C                                 | –  | –  | 5.138.145   | –  |
| 1D                                 | 96.633.572 <sup>(1)</sup>  | 145.798.554 <sup>(1)</sup>                                     | –   | 37.832.385 <sup>(1)</sup>  |
| 2C                                 | 10.058.691   | –  | –   | –  |
| 3D                                 | – <sup>(2)</sup>   | –  | –   | –  |
| 4C                                 | 205.001.625 <sup>(3)</sup>   | –  | –   | –  |
| 5C                                 | 267.925.534 <sup>(4)</sup>   | –  | –   | –  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |  |   |  |
| 1C                                 | –  | –  | –   | –  |
| 1D                                 | 32.072.508 <sup>(1)</sup>  | –  | –   | –  |
| 2C                                 | 1.433.278  | –  | –   | –  |
| 3D                                 | – <sup>(2)</sup>   | –  | –   | –  |
| 4C                                 | 163.246.383 <sup>(3)</sup>   | –  | –   | –  |
| 5C                                 | 367.104.663 <sup>(4)</sup>   | –  | –   | –  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b> |  |  |   |  |
| <b>30. Juni 2016</b>               |  |  |   |  |
| 1C                                 | –  | –  | 61,25   | –  |
| 1D                                 | 46,83 <sup>(1)</sup>   | 17,18 <sup>(1)</sup>   | –   | 9,61 <sup>(1)</sup>  |
| 2C                                 | 50,52  | –  | –   | –  |
| 3D                                 | 77,42 <sup>(2)</sup>   | –  | –   | –  |
| 4C                                 | 17,83 <sup>(3)</sup>   | –  | –   | –  |
| 5C                                 | 22,08 <sup>(4)</sup>   | –  | –   | –  |
| <b>31. Dezember 2015</b>           |  |  |   |  |
| 1C                                 | –  | –  | 63,88   | –  |
| 1D                                 | 43,98 <sup>(1)</sup>   | 16,92 <sup>(1)</sup>   | –   | 9,71 <sup>(1)</sup>  |
| 2C                                 | 47,79  | –  | –   | –  |
| 3D                                 | – <sup>(2)</sup>   | –  | –   | –  |
| 4C                                 | 17,01 <sup>(3)</sup>   | –  | –   | –  |
| 5C                                 | 21,00 <sup>(4)</sup>   | –  | –   | –  |
| <b>31. Dezember 2014</b>           |  |  |   |  |
| 1C                                 | –  | –  | –   | –  |
| 1D                                 | 45,54 <sup>(1)</sup>   | –  | –   | –  |
| 2C                                 | 47,45  | –  | –   | –  |
| 3D                                 | – <sup>(2)</sup>   | –  | –   | –  |
| 4C                                 | 17,15 <sup>(3)</sup>   | –  | –   | –  |
| 5C                                 | 20,92 <sup>(4)</sup>   | –  | –   | –  |

<sup>(1)</sup>Diese Anteilsklasse wurde bis einschließlich 17. Dezember 2015 mit „1C“ bezeichnet.<sup>(2)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf GBP.<sup>(3)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf CHF.<sup>(4)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf EUR.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Statistik (Fortsetzung)

**db x-trackers II  
HARVEST CSI  
CHINA  
SOVEREIGN  
BOND UCITS ETF  
(DR)**

USD

**Nettoinventarwert insgesamt**

**30. Juni 2016**

1D 27.581.483

**31. Dezember 2015**

1D 27.965.923

**31. Dezember 2014**

1D –

**Nettoinventarwert je Anteil**

**30. Juni 2016**

1D 22,07

**31. Dezember 2015**

1D 22,37

**31. Dezember 2014**

1D –

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 1-3<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 3-5<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 5-7<br>UCITS ETF* |
|---|---|---|---|---|
|   | EUR   | EUR   | EUR   | EUR   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |   |   |   |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 1.675.973.803   | 363.009.393   | 463.843.652   | 275.724.713   |
| Bankguthaben                                      | 0   | 4.502   | 930.914   | 5.378   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 28.132.380  | 0   | 6.086.910   | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 20.793.530  | 0   | 6.131.345   | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 37.346.957  | 0   | 8.495   | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0   | 0   | 0   | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 21.493.704  | 4.408.113   | 6.215.200   | 4.558.426   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 82.662.250  | 9.198.058   | 24.807.194  | 15.015.544  |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>1.866.402.624</b>  | <b>376.620.066</b>  | <b>508.023.710</b>  | <b>295.304.061</b>  |
| <b>PASSIVA</b>                                    |   |   |   |   |
| Kontokorrentkredite                               | 186.791   | 0   | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 58.132.506  | 0   | 6.139.839   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 28.132.531  | 0   | 6.086.885   | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 82.694.651  | 9.718.574   | 19.736.140  | 15.660.687  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 0   | 0   | 0   | 0   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 210.673   | 45.844  | 60.581  | 35.337  |
| Fixgebühr   | 5 421.345   | 91.687  | 121.161   | 70.673  |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0   | 0   | 0   | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>169.778.497</b>  | <b>9.856.105</b>  | <b>32.144.606</b>   | <b>15.766.697</b>   |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>1.696.624.127</b>  | <b>366.763.961</b>  | <b>475.879.104</b>  | <b>279.537.364</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |   |   |   |   |
| 1C  | 234,89  | 170,04  | 203,03  | 235,93  |
| 1D  | 206,02  | 160,90  | 192,46  | –   |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |   |   |   |   |
| 1C  | 7.028.745   | 2.134.517   | 2.263.314   | 1.184.821   |
| 1D  | 221.529   | 23.659  | 84.945  | –   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 7-10<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 10-<br>15 UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 15+<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE 25+<br>UCITS ETF* |
|---|--|--|---|---|
|   | EUR  | EUR  | EUR   | EUR   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |  |   |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 150.203.958  | 28.007.499   | 44.891.605  | 55.178.239  |
| Bankguthaben                                      | 3.932  | 9.378  | 6.868   | 3.742   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0  | 0  | 32.755  | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 1.720.306  | 280.349  | 406.347   | 390.265   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 5.884.746  | 1.096.082  | 0   | 862.381   |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>157.812.942</b>   | <b>29.393.308</b>  | <b>45.337.575</b>   | <b>56.434.627</b>   |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |  |   |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 2.368.957  | 3.140.244  | 0   | 6.087   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 0  | 0  | 587.465   | 0   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 24.572   | 3.250  | 4.988   | 4.765   |
| Fixgebühr   | 5 49.143   | 6.499  | 9.976   | 9.529   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0  | 0   | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>2.442.672</b>   | <b>3.149.993</b>   | <b>602.429</b>  | <b>20.381</b>   |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>155.370.270</b>   | <b>26.243.315</b>  | <b>44.735.146</b>   | <b>56.414.246</b>   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |  |   |   |
| 1C  | 260,25   | 284,08   | 352,13  | 374,33  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |  |   |   |
| 1C  | 597.002  | 92.379   | 127.042   | 150.709   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II                                   | db x-trackers II                                 | db x-trackers II    | db x-trackers II                |
|---|--|--|---------------------|---------------------------------|
|   | IBOXX GLOBAL<br>INFLATION-<br>LINKED UCITS<br>ETF* | IBOXX EURO<br>INFLATION-<br>LINKED UCITS<br>ETF* | EONIA UCITS<br>ETF* | ITRAXX®<br>EUROPE UCITS<br>ETF* |
|   | EUR  | EUR  | EUR                 | EUR                             |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |  |                     |                                 |
| Anlagen zum Marktwert                             | 657.416.204  | 369.711.306                                      | 602.859.233         | 33.936.973                      |
| Bankguthaben                                      | 43.225   | 0  | 1.404.627           | 1.087                           |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 212.339  | 0  | 0                   | 0                               |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0  | 0                   | 0                               |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0  | 0  | 0                   | 0                               |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 106.184.884                                      | 0  | 35.131.546          | 608.913                         |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 5.021.435  | 3.601.964  | 5.363.006           | 238.113                         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0  | 11.028.737                                       | 0                   | 0                               |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>768.878.087</b>                                 | <b>384.342.007</b>                               | <b>644.758.412</b>  | <b>34.785.086</b>               |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |  |                     |                                 |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 1.534  | 0                   | 0                               |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0  | 0  | 0                   | 0                               |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 212.330  | 0  | 34.628              | 0                               |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 0  | 8.438.837  | 0                   | 0                               |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 94.378.978                                       | 0  | 27.818.385          | 375.226                         |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 230.511  | 82.813   | 63.271              | 6.204                           |
| Fixgebühr   | 5 153.674  | 82.812   | 133.346             | 7.756                           |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0  | 0                   | 0                               |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>94.975.493</b>                                  | <b>8.605.996</b>                                 | <b>28.049.630</b>   | <b>389.186</b>                  |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>673.902.594</b>                                 | <b>375.736.011</b>                               | <b>616.708.782</b>  | <b>34.395.900</b>               |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |  |                     |                                 |
| 1C  | 225,45   | 214,15   | 139,12              | 116,11                          |
| 1D  | 211,80   | –  | 130,23              | –                               |
| 2C  | 23,61 <sup>(1)</sup>                               | –  | 140,00              | –                               |
| 3D  | 24,54 <sup>(2)</sup>                               | –  | –                   | –                               |
| 4D  | 109,42 <sup>(3)</sup>                              | –  | –                   | –                               |
| 5C  | 21,34  | –  | –                   | –                               |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |  |                     |                                 |
| 1C  | 2.369.840  | 1.754.587  | 4.099.349           | 296.240                         |
| 1D  | 51.125   | –  | 65.410              | –                               |
| 2C  | 3.459.119  | –  | 270.574             | –                               |
| 3D  | 677.258  | –  | –                   | –                               |
| 4D  | 163.928  | –  | –                   | –                               |
| 5C  | 876.015  | –  | –                   | –                               |

<sup>(1)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf USD.<sup>(2)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf GBP.<sup>(3)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf CHF.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

## Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>ITRAXX®<br>CROSSOVER<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>ITRAXX®<br>EUROPE SHORT<br>DAILY UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>ITRAXX®<br>CROSSOVER<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>EMERGING<br>MARKETS<br>LIQUID<br>EUROBOND<br>UCITS ETF* |
|---|--|--|---|---|
|   | EUR  | EUR  | EUR   | EUR   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |  |   |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 331.032.960  | 6.383.608  | 46.066.571  | 429.240.229   |
| Bankguthaben                                      | 102.191  | 1.541  | 3.791   | 291   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 860.120  | 0  | 1.028.048   | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0  | 0   | 6.251.628   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0  | 0  | 0   | 227.010   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 27.317.577   | 0  | 2.610.629   | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 3.620.272  | 69.050   | 507.367   | 5.944.614   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0  | 0  | 0   | 30.739.942  |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>362.933.120</b>                                     | <b>6.454.199</b>   | <b>50.216.406</b>   | <b>472.403.714</b>  |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |  |   |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0  | 0  | 0   | 6.475.454   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 860.143  | 0  | 1.028.048   | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 0  | 2.137.053  | 0   | 29.310.356  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 18.754.439   | 740.218  | 2.451.904   | 0   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 87.190   | 709  | 11.468  | 446.273   |
| Fixgebühr   | 5 62.278   | 887  | 8.191   | 99.172  |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0  | 0   | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>19.764.050</b>                                      | <b>2.878.867</b>   | <b>3.499.611</b>  | <b>36.331.255</b>   |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>343.169.070</b>                                     | <b>3.575.332</b>   | <b>46.716.795</b>   | <b>436.072.459</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |  |   |   |
| 1C  | 172,32   | 96,10  | 51,31   | 318,66  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |  |   |   |
| 1C  | 1.991.410  | 37.205   | 910.465   | 1.368.446   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>SHORT IBOXX €<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>DAILY UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>GERMANY<br>COVERED<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX £ GILTS<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX UK GILT<br>INFLATION-<br>LINKED UCITS<br>ETF* |
|---|--|---|---|---|
|   | EUR  | EUR   | GBP   | GBP   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |   |   |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 169.722.938  | 160.561.799   | 6.041.028                                       | 14.324.556  |
| Bankguthaben                                      | 312  | 3.189   | 1.588   | 396   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0  | 0   | 0   | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0   | 0   | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0  | 0   | 0   | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 48.010.305   | 0   | 0   | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 2.595.085  | 1.742.911   | 49.683  | 39.886  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0  | 15.411.152  | 0   | 0   |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>220.328.640</b>   | <b>177.719.051</b>  | <b>6.092.299</b>                                | <b>14.364.838</b>   |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |   |   |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 0   | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0  | 0   | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0  | 0   | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 0  | 14.108.278  | 655.074   | 7.084.167   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 52.665.188   | 0   | 355.852   | 1.080.601   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 21.229   | 20.608  | 1.197   | 1.386   |
| Fixgebühr   | 5 42.459   | 41.217  | 1.196   | 1.387   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0   | 0   | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>52.728.876</b>  | <b>14.170.103</b>   | <b>1.013.319</b>                                | <b>8.167.541</b>  |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>167.599.764</b>   | <b>163.548.948</b>  | <b>5.078.980</b>                                | <b>6.197.297</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |   |   |   |
| 1C  | 77,45  | 197,10  | –   | –   |
| 1D  | –  | 191,15  | 260,98  | 276,46  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |   |   |   |
| 1C  | 2.164.082  | 818.081   | –   | –   |
| 1D  | –  | 12.040  | 19.461  | 22.417  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

## Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>FED FUNDS<br>EFFECTIVE<br>RATE UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>STERLING<br>CASH UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>GLOBAL<br>SOVEREIGN<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MARKIT IBOXX<br>ABF INDONESIA<br>GOVERNMENT<br>UCITS ETF* |
|---|--|--|---|---|
|   | USD  | GBP  | EUR   | USD   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |  |   |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 649.440.134  | 79.237.764   | 796.837.068   | 4.891.434   |
| Bankguthaben                                      | 76.130   | 156.733  | 23.418  | 2.519   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0  | 0  | 6.387.029   | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 27.881.293   | 0  | 0   | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 4.995.181  | 1.004.610  | 8.453.400   | 29.758  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0  | 0  | 3.505.436   | 284.218   |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>682.392.738</b>   | <b>80.399.107</b>                                  | <b>815.206.351</b>                                    | <b>5.207.929</b>  |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |  |   |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0  | 0  | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0  | 0  | 6.387.209   | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 0  | 8.174.572  | 46.473.456  | 111.683   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 27.546.054   | 12.693.165   | 0   | 0   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 79.894   | 10.285   | 274.168   | 3.677   |
| Fixgebühr   | 5 159.787  | 20.569   | 182.618   | 1.226   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0  | 0   | 3.768   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>27.785.735</b>  | <b>20.898.591</b>                                  | <b>53.317.451</b>                                     | <b>120.354</b>  |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>654.607.003</b>   | <b>59.500.516</b>                                  | <b>761.888.900</b>                                    | <b>5.087.575</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |  |   |   |
| 1C  | 170,67   | –  | 234,52  | 10,74   |
| 1D  | –  | 183,54   | 222,91  | –   |
| 2D  | –  | –  | 27,56 <sup>(1)</sup>                                  | –   |
| 4C  | –  | –  | 183,79 <sup>(2)</sup>                                 | –   |
| 5C  | –  | –  | 248,72  | –   |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |  |   |   |
| 1C  | 3.835.491  | –  | 1.743.434   | 473.714   |
| 1D  | –  | 324.187  | 739.455   | –   |
| 2D  | –  | –  | 1.153.414   | –   |
| 4C  | –  | –  | 730.512   | –   |
| 5C  | –  | –  | 104.099   | –   |

<sup>(1)</sup> Die Anteilsklasse lautet auf GBP.<sup>(2)</sup> Die Anteilsklasse lautet auf CHF.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>MARKIT IBOXX<br>ABF<br>SINGAPORE<br>GOVERNMENT<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>SINGAPORE<br>DOLLAR CASH<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX £ GILTS<br>1-5 UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX \$<br>TREASURIES<br>UCITS ETF (DR) |
|---|--|--|---|--|
|   | SGD  | SGD  | GBP   | USD  |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |  |   |  |
| Anlagen zum Marktwert                             | 41.252.391   | 1.105.682  | 5.708.471   | 173.125.283  |
| Bankguthaben                                      | 7.365  | 20.508   | 3.341   | 434.125  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0  | 0  | 0   | 0  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0  | 0   | 0  |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0  | 0  | 0   | 0  |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0  | 0  | 0   | 0  |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 299.163  | 7.706  | 52.971  | 907.671  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 4.107.772  | 236.593  | 134.748   | 0  |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>45.666.691</b>  | <b>1.370.489</b>   | <b>5.899.531</b>                                    | <b>174.467.079</b>   |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |  |   |  |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 0  | 0   | 0  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0  | 0  | 0   | 56.136   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0  | 0  | 0   | 0  |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 3.601.368  | 211.252  | 4.141   | 0  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 0  | 0  | 0   | 0  |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 10.376   | 144  | 1.450   | 28.944   |
| Fixgebühr   | 5 10.376   | 288  | 1.451   | 57.888   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0  | 0   | 0  |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>3.622.120</b>   | <b>211.684</b>   | <b>7.042</b>  | <b>142.968</b>   |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>42.044.571</b>  | <b>1.158.805</b>   | <b>5.892.489</b>                                    | <b>174.324.111</b>   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |  |   |  |
| 1C  | 137,28   | 107,53   | –   | –  |
| 1D  | –  | –  | 256,02  | 222,32   |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |  |   |  |
| 1C  | 306.264  | 10.777   | –   | –  |
| 1D  | –  | –  | 23.016  | 784.103  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II                      | db x-trackers II   | db x-trackers II                           | db x-trackers II                             |
|---|---------------------------------------|--|--|--|
|   | UK GILTS<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* | IBOXX \$<br>TREASURIES<br>INFLATION-<br>LINKED UCITS<br>ETF (DR) | US TREASURIES<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* | IBOXX \$<br>TREASURIES 1-3<br>UCITS ETF (DR) |
|   | GBP                                   | USD  | USD  | USD  |
| <b>AKTIVA</b>                                     |                                       |  |  |  |
| Anlagen zum Marktwert                             | 12.980.745                            | 20.657.482   | 5.235.010                                  | 52.818.246                                   |
| Bankguthaben                                      | 265                                   | 854  | 6.796                                      | 150.494                                      |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0                                     | 0  | 0  | 0  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0                                     | 0  | 0  | 0  |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0                                     | 0  | 0  | 0  |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 2.147.035                           | 0  | 351.649                                    | 0  |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 83.240                                | 74.569   | 85.962                                     | 208.750                                      |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0                                   | 0  | 0  | 0  |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>15.211.285</b>                     | <b>20.732.905</b>  | <b>5.679.417</b>                           | <b>53.177.490</b>                            |
| <b>PASSIVA</b>                                    |                                       |  |  |  |
| Kontokorrentkredite                               | 0                                     | 0  | 0  | 0  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0                                     | 0  | 0  | 0  |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0                                     | 0  | 0  | 0  |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 0                                   | 0  | 0  | 0  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 3.669.516                           | 0  | 782.879                                    | 0  |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 3.410                               | 3.151  | 1.850                                      | 13.669                                       |
| Fixgebühr   | 5 2.273                               | 3.150  | 1.234                                      | 27.339                                       |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0                                     | 0  | 0  | 0  |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>3.675.199</b>                      | <b>6.301</b>   | <b>785.963</b>                             | <b>41.008</b>                                |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>11.536.086</b>                     | <b>20.726.604</b>  | <b>4.893.454</b>                           | <b>53.136.482</b>                            |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |                                       |  |  |  |
| 1C  | 86,10                                 | –  | 79,06                                      | –  |
| 1D  | –                                     | 285,14 <sup>(1)</sup>  | –  | 169,27 <sup>(1)</sup>                        |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |                                       |  |  |  |
| 1C  | 133.987                               | –  | 61.898                                     | –  |
| 1D  | –                                     | 72.688 <sup>(1)</sup>  | –  | 313.907 <sup>(1)</sup>                       |

<sup>(1)</sup>Diese Anteilsklasse wurde bis einschließlich 20. März 2016 mit „1C“ bezeichnet.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>IBOXX EUR<br>LIQUID<br>CORPORATE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>GERMANY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>GERMANY 1-3<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MARKIT IBOXX<br>ABF KOREA<br>GOVERNMENT<br>UCITS ETF* |
|---|--|--|--|---|
|   | EUR  | EUR  | EUR  | USD   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |  |  |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 262.196.827  | 93.054.332   | 54.890.847   | 18.336.294  |
| Bankguthaben                                      | 213  | 644  | 982  | 3.797   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 6.712.160  | 0  | 0  | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0  | 0  | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 12.185.438   | 0  | 0  | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0  | 0  | 0  | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 3.542.766  | 1.592.043  | 529.282  | 97.628  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 8.114.034  | 1.149.840  | 144.829  | 2.319.842   |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>292.751.438</b>   | <b>95.796.859</b>                                  | <b>55.565.940</b>                                      | <b>20.757.561</b>   |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |  |  |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 0  | 0  | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 12.036.962   | 0  | 0  | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 6.712.169  | 0  | 0  | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 7.884.507  | 5.701.333  | 681.002  | 2.772.487   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 0  | 0  | 0  | 0   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 61.276   | 12.024   | 9.408  | 3.825   |
| Fixgebühr   | 5 61.275   | 24.062   | 18.817   | 3.825   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0  | 0  | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>26.756.189</b>  | <b>5.737.419</b>                                   | <b>709.227</b>   | <b>2.780.137</b>  |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>265.995.249</b>   | <b>90.059.440</b>                                  | <b>54.856.713</b>                                      | <b>17.977.424</b>   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |  |  |   |
| 1C  | 149,28   | 203,10   | –  | 159,05  |
| 1D  | –  | 208,57   | 148,95   | –   |
| 2C  | 114,38   | –  | –  | –   |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |  |  |   |
| 1C  | 1.600.935  | 32.140   | –  | 113.029   |
| 1D  | –  | 400.494  | 368.286  | –   |
| 2C  | 236.178  | –  | –  | –   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

|   | db x-trackers II<br>IBOXX EUR<br>LIQUID<br>CORPORATE<br>FINANCIALS<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX EUR<br>LIQUID<br>CORPORATE<br>NON-<br>FINANCIALS<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>AAA UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>YIELD PLUS<br>UCITS ETF* |
|---|--|--|--|---|
|   | EUR  | EUR  | EUR  | EUR   |
| <b>Erläuterungen</b>                              |  |  |  |   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |  |  |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 15.084.052   | 56.868.279   | 199.134.767  | 1.826.192.289   |
| Bankguthaben                                      | 1.704  | 15.455   | 32.180   | 34.124  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0  | 0  | 3.455.168  | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0  | 0  | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0  | 0  | 4.570.325  | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4  | 0  | 0  | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 255.209  | 659.591  | 2.640.625  | 22.796.245  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4  | 1.520.757  | 3.784.716  | 97.411.304  |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>16.861.722</b>  | <b>58.798.885</b>  | <b>213.617.781</b>   | <b>1.946.433.962</b>  |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |  |  |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 0  | 0  | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0  | 0  | 4.570.325  | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0  | 0  | 3.455.128  | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4  | 1.684.448  | 4.154.845  | 113.079.315   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4  | 0  | 0  | 0   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5  | 3.767  | 13.885   | 245.358   |
| Fixgebühr   | 5  | 3.768  | 13.885   | 490.717   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0  | 0  | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>1.691.983</b>   | <b>1.063.918</b>   | <b>12.257.126</b>  | <b>113.815.390</b>  |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>15.169.739</b>  | <b>57.734.967</b>  | <b>201.360.655</b>   | <b>1.832.618.572</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |  |  |   |
| 1C  | 147,64   | 149,40   | 230,59   | 173,66  |
| 1D  | –  | –  | 225,14   | 167,59  |
| 2C  | 113,96   | 113,56   | –  | 113,20  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |  |  |   |
| 1C  | 97.327   | 368.942  | 540.588  | 9.053.942   |
| 1D  | –  | –  | 340.707  | 929.375   |
| 2C  | 7.027  | 23.022   | –  | 923.894   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>AUSTRALIAN<br>DOLLAR CASH<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>AUSTRALIA SSA<br>BONDS UCITS<br>ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>GERMANY<br>COVERED 1-3<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>ITRAXX®<br>CROSSOVER 2X<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* |
|---|---|--|---|--|
|   | AUD   | AUD  | EUR   | EUR  |
| <b>AKTIVA</b>                                     |   |  |   |  |
| Anlagen zum Marktwert                             | 36.663.991  | 45.597.434   | 7.823.926   | 21.175.048   |
| Bankguthaben                                      | 9.836   | 1.039  | 1.791   | 396  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0   | 0  | 0   | 0  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0   | 0  | 0   | 0  |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0   | 0  | 0   | 0  |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0   | 0  | 0   | 0  |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 343.267   | 259.128  | 79.674  | 122.099  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0   | 3.135.902  | 0   | 0  |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>37.017.094</b>   | <b>48.993.503</b>  | <b>7.905.391</b>  | <b>21.297.543</b>  |
| <b>PASSIVA</b>                                    |   |  |   |  |
| Kontokorrentkredite                               | 0   | 0  | 0   | 0  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0   | 0  | 0   | 0  |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0   | 0  | 0   | 0  |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 4.855.744   | 6.764.413  | 310.798   | 846.477  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 166.118   | 0  | 85.101  | 208.655  |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 7.202   | 16.919   | 1.138   | 3.088  |
| Fixgebühr   | 5 7.541   | 11.280   | 2.277   | 1.286  |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0   | 0  | 0   | 0  |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>5.036.605</b>  | <b>6.792.612</b>   | <b>399.314</b>  | <b>1.059.506</b>   |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>31.980.489</b>   | <b>42.200.891</b>  | <b>7.506.077</b>  | <b>20.238.037</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |   |  |   |  |
| 1C  | 223,73  | 222,07   | 171,96  | 22,39  |
| 2C  | 223,73  | –  | –   | –  |
| 3C  | 223,73  | –  | –   | –  |
| 4C  | 22,39   | –  | –   | –  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |   |  |   |  |
| 1C  | 132.912   | 190.034  | 43.651  | 903.877  |
| 2C  | 2.005   | –  | –   | –  |
| 3C  | 2.005   | –  | –   | –  |
| 4C  | 60.130  | –  | –   | –  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>IBOXX GBP<br>LIQUID<br>CORPORATE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MTS EX-BANK<br>OF ITALY BOT<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MTS EX-BANK<br>OF ITALY<br>AGGREGATE<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MTS EX-BANK<br>OF ITALY BTP<br>UCITS ETF* |
|---|--|---|--|---|
|   | GBP  | EUR   | EUR  | EUR   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |  |   |  |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 5.434.270  | 180.236.622   | 74.229.856   | 18.461.814  |
| Bankguthaben                                      | 5.544  | 1.217   | 1.121  | 19.074  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0  | 0   | 0  | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0  | 0   | 0  | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0  | 0   | 0  | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0  | 0   | 0  | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 65.259   | 1.582.204   | 900.205  | 195.925   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0  | 6.229.937   | 231.460  | 0   |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>5.505.073</b>   | <b>188.049.980</b>  | <b>75.362.642</b>  | <b>18.676.813</b>   |
| <b>PASSIVA</b>                                    |  |   |  |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0  | 0   | 0  | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0  | 0   | 0  | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0  | 0   | 0  | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 1.920.833  | 8.649.108   | 1.030.613  | 252.227   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 272.426  | 0   | 0  | 241.820   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 798  | 26.450  | 18.722   | 5.487   |
| Fixgebühr   | 5 798  | 52.901  | 18.723   | 5.486   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0  | 0   | 0  | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>2.194.855</b>   | <b>8.728.459</b>  | <b>1.068.058</b>   | <b>505.020</b>  |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>3.310.218</b>   | <b>179.321.521</b>  | <b>74.294.584</b>  | <b>18.171.793</b>   |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |  |   |  |   |
| 1C  | –  | 31,81   | –  | –   |
| 1D  | 162,94   | –   | 51,92  | 65,23   |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |  |   |  |   |
| 1C  | –  | 5.638.082   | –  | –   |
| 1D  | 20.315   | –   | 1.430.810  | 278.584   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II                   | db x-trackers II                                | db x-trackers II                    | db x-trackers II                             |
|---|------------------------------------|---|-------------------------------------|--|
|   | IBOXX<br>GERMANY 3-5<br>UCITS ETF* | SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>AAA 1-3 UCITS<br>ETF* | IBOXX<br>GERMANY 7-10<br>UCITS ETF* | IBOXX EUR<br>LIQUID<br>COVERED<br>UCITS ETF* |
|   | EUR                                | EUR   | EUR                                 | EUR  |
| <b>AKTIVA</b>                                     |                                    |   |                                     |  |
| Anlagen zum Marktwert                             | 2.866.167                          | 2.863.131                                       | 2.925.703                           | 53.290.791                                   |
| Bankguthaben                                      | 1.902                              | 1.587   | 1.619                               | 0  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0                                  | 0   | 0                                   | 0  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0                                  | 0   | 0                                   | 0  |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0                                  | 0   | 0                                   | 0  |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0                                | 0   | 63.828                              | 0  |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 18.166                             | 70.938  | 28.283                              | 578.921                                      |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 1.752                            | 110.278   | 23.214                              | 1.185.273                                    |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>2.887.987</b>                   | <b>3.045.934</b>                                | <b>3.042.647</b>                    | <b>55.054.985</b>                            |
| <b>PASSIVA</b>                                    |                                    |   |                                     |  |
| Kontokorrentkredite                               | 0                                  | 0   | 0                                   | 556  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0                                  | 0   | 0                                   | 0  |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0                                  | 0   | 0                                   | 0  |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 281.818                          | 89.483  | 0                                   | 46.896                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 0                                | 0   | 0                                   | 0  |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 231                              | 352   | 539                                 | 12.562                                       |
| Fixgebühr   | 5 461                              | 705   | 1.078                               | 12.561                                       |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0                                  | 0   | 0                                   | 0  |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>282.510</b>                     | <b>90.540</b>                                   | <b>1.617</b>                        | <b>72.575</b>                                |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>2.605.477</b>                   | <b>2.955.394</b>                                | <b>3.041.030</b>                    | <b>54.982.410</b>                            |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |                                    |   |                                     |  |
| 1C  | –                                  | 162,57  | –                                   | 157,04                                       |
| 1D  | 184,62                             | –   | 247,36                              | –  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |                                    |   |                                     |  |
| 1C  | –                                  | 18.179  | –                                   | 350.110                                      |
| 1D  | 14.113                             | –   | 12.294                              | –  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>MTS ITALY<br>AGGREGATE 1-<br>3 YEARS - EX-<br>BANK OF ITALY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>MTS ITALY<br>AGGREGATE 3-<br>5 YEARS - EX-<br>BANK OF ITALY<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>CANADIAN<br>DOLLAR CASH<br>UCITS ETF* | db x-trackers II<br>IBOXX<br>SOVEREIGNS<br>EUROZONE<br>YIELD PLUS 1-3<br>UCITS ETF* |
|---|---|---|---|---|
|   | EUR   | EUR   | CAD   | EUR   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |   |   |   |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 4.811.935   | 6.033.709   | 28.210.681  | 866.168.927   |
| Bankguthaben                                      | 888   | 1.643   | 874   | 2.778   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0   | 0   | 0   | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0   | 0   | 0   | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0   | 0   | 0   | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0   | 0   | 0   | 0   |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 69.402  | 46.780  | 246.220   | 11.038.987  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 125.908   | 110.023   | 845.344   | 25.277.344  |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>5.008.133</b>  | <b>6.192.155</b>  | <b>29.303.119</b>   | <b>902.488.036</b>  |
| <b>PASSIVA</b>                                    |   |   |   |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0   | 0   | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0   | 0   | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0   | 0   | 0   | 0   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 205.849   | 2.151.917   | 1.624.089   | 63.093.025  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 0   | 0   | 0   | 0   |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 584   | 1.015   | 3.437   | 112.579   |
| Fixgebühr   | 5 1.167   | 1.016   | 10.311  | 225.157   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0   | 0   | 0   | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>207.600</b>  | <b>2.153.948</b>  | <b>1.637.837</b>  | <b>63.430.761</b>   |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>4.800.533</b>  | <b>4.038.207</b>  | <b>27.665.282</b>   | <b>839.057.275</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |   |   |   |   |
| 1C  | –   | –   | 162,51  | 142,24  |
| 1D  | 46,13   | 53,29   | –   | 138,08  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |   |   |   |   |
| 1C  | –   | –   | 170.242   | 5.678.631   |
| 1D  | 104.064   | 75.780  | –   | 226.962   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II          | db x-trackers II               | db x-trackers II                                 | db x-trackers II  |
|---|---------------------------|--------------------------------|--|---|
|   | IBOXX SPAIN<br>UCITS ETF* | IBOXX SPAIN 1-<br>3 UCITS ETF* | MARKIT IBOXX<br>JAPAN<br>SOVEREIGN<br>UCITS ETF* | MARKIT IBOXX<br>JAPAN<br>SOVEREIGN<br>SHORT DAILY<br>UCITS ETF* |
|   | EUR                       | EUR                            | JPY  | JPY   |
| <b>AKTIVA</b>                                     |                           |                                |  |   |
| Anlagen zum Marktwert                             | 1.303.402                 | 6.159.017                      | 6.430.247.038                                    | 735.598.652   |
| Bankguthaben                                      | 916                       | 521                            | 2.698  | 0   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0                         | 0                              | 0  | 469.547   |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0                         | 0                              | 0  | 0   |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0                         | 0                              | 0  | 0   |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 0                       | 0                              | 0  | 76.820.463  |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 30.553                    | 103.430                        | 9.762.299  | 5.717.569   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0                       | 126.191                        | 190.702.895                                      | 0   |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>1.334.871</b>          | <b>6.389.159</b>               | <b>6.630.714.930</b>                             | <b>818.606.231</b>  |
| <b>PASSIVA</b>                                    |                           |                                |  |   |
| Kontokorrentkredite                               | 0                         | 0                              | 0  | 9.870   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0                         | 0                              | 0  | 0   |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0                         | 0                              | 0  | 469.537   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 247.885                 | 403.819                        | 126.543.508                                      | 0   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 41.477                  | 0                              | 0  | 77.997.733  |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 254                     | 462                            | 795.854  | 279.640   |
| Fixgebühr   | 5 254                     | 925                            | 1.591.707  | 186.426   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0                         | 0                              | 0  | 0   |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>289.870</b>            | <b>405.206</b>                 | <b>128.931.069</b>                               | <b>78.943.206</b>   |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>1.045.001</b>          | <b>5.983.953</b>               | <b>6.501.783.861</b>                             | <b>739.663.025</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |                           |                                |  |   |
| 1C  | 24,48                     | 18,83                          | 1.431,41   | 666,45  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |                           |                                |  |   |
| 1C  | 42.681                    | 317.740                        | 4.542.232  | 1.109.861   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30 Juni 2016 (Fortsetzung)

| <b>Erläuterungen</b>                              | <b>db x-trackers II<br/>BARCLAYS<br/>GLOBAL<br/>AGGREGATE<br/>BOND UCITS<br/>ETF*<br/>USD</b> | <b>db x-trackers II<br/>IBOXX EUR<br/>HIGH YIELD<br/>BOND UCITS<br/>ETF*<br/>EUR</b> | <b>db x-trackers II<br/>IBOXX EUR<br/>HIGH YIELD<br/>BOND SHORT<br/>DAILY UCITS<br/>ETF*<br/>EUR</b> | <b>db x-trackers II<br/>IBOXX EUR<br/>HIGH YIELD<br/>BOND 1-3 UCITS<br/>ETF*<br/>EUR</b> |
|---|---|--|--|--|
| <b>AKTIVA</b>                                     |   |  |  |  |
| Anlagen zum Marktwert                             | 955.482.708   | 193.444.836  | 3.514.806  | 67.497.354   |
| Bankguthaben                                      | 361.979   | 261  | 2.969  | 508  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 9.486.658   | 0  | 0  | 0  |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0   | 0  | 0  | 0  |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0   | 0  | 0  | 0  |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4 14.907.420  | 59.047   | 12.800   | 3.190.103  |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 7.563.299   | 2.000.480  | 50.175   | 847.720  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4 0   | 0  | 0  | 0  |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>987.802.064</b>  | <b>195.504.624</b>   | <b>3.580.750</b>   | <b>71.535.685</b>  |
| <b>PASSIVA</b>                                    |   |  |  |  |
| Kontokorrentkredite                               | 0   | 0  | 0  | 0  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0   | 0  | 0  | 0  |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 9.487.141   | 0  | 0  | 0  |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4 0   | 0  | 0  | 0  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4 7.485.771   | 757.994  | 173.253  | 2.202.499  |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5 422.961   | 110.839  | 1.564  | 37.869   |
| Fixgebühr   | 5 211.479   | 44.335   | 626  | 15.148   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 0   | 0  | 0  | 0  |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>17.607.352</b>   | <b>913.168</b>   | <b>175.443</b>   | <b>2.255.516</b>   |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>970.194.712</b>  | <b>194.591.456</b>   | <b>3.405.307</b>   | <b>69.280.169</b>  |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |   |  |  |  |
| 1C  | –   | –  | 61,25  | –  |
| 1D  | 46,83   | 17,18  | –  | 9,61   |
| 2C  | 50,52   | –  | –  | –  |
| 3D  | 77,42 <sup>(1)</sup>  | –  | –  | –  |
| 4C  | 17,83 <sup>(2)</sup>  | –  | –  | –  |
| 5C  | 22,08 <sup>(3)</sup>  | –  | –  | –  |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |   |  |  |  |
| 1C  | –   | –  | 55.601   | –  |
| 1D  | 1.430.407   | 11.328.145   | –  | 7.212.853  |
| 2C  | 2.495.885   | –  | –  | –  |
| 3D  | 70.000  | –  | –  | –  |
| 4C  | 15.595.964  | –  | –  | –  |
| 5C  | 19.750.792  | –  | –  | –  |

<sup>(1)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf GBP.

<sup>(2)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf CHF.

<sup>(3)</sup>Die Anteilsklasse lautet auf EUR.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



## db x-trackers II\*\*

Nettovermögensaufstellung zum 30 Juni 2016 (Fortsetzung)

| Erläuterungen                                     | db x-trackers II<br>HARVEST CSI<br>CHINA<br>SOVEREIGN<br>BOND UCITS<br>ETF (DR) |                       | TOTAL       |
|---|---|-----------------------|-------------|
|   | USD   | EUR                   |             |
| <b>AKTIVA</b>                                     |   |                       |             |
| Anlagen zum Marktwert                             | 25.902.777  | 12.711.149.905        |             |
| Bankguthaben                                      | 1.349.209   | 5.049.060             |             |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Fondsanteilen  | 0   | 61.417.509            |             |
| Forderungen aus dem Verkauf von<br>Anlagen        | 0   | 33.176.503            |             |
| Forderungen aus Swap-Kontrakten                   | 0   | 54.338.225            |             |
| Forderungen gegenüber Swap-<br>Kontrahenten       | 4   | 0                     | 265.311.906 |
| Zins- und Dividendenforderungen,<br>netto         | 371.179   | 141.786.611           |             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps               | 4   | 0                     | 356.786.506 |
| <b>SUMME AKTIVA</b>                               | <b>27.623.165</b>   | <b>13.629.016.225</b> |             |
| <b>PASSIVA</b>                                    |   |                       |             |
| Kontokorrentkredite                               | 0   | 188.970               |             |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von<br>Anlagen     | 0   | 87.405.616            |             |
| Verbindlichkeiten aus Swap-<br>Kontrakten         | 0   | 61.452.860            |             |
| Verbindlichkeiten gegenüber Swap-<br>Kontrahenten | 4   | 0                     | 482.260.389 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps              | 4   | 0                     | 256.261.654 |
| Verwaltungsgesellschaftsgebühr                    | 5   | 27.752                | 2.924.057   |
| Fixgebühr   | 5   | 10.407                | 3.146.830   |
| Ausstehende Gebühren und<br>Aufwendungen          | 3.523   | 6.563                 |             |
| <b>SUMME PASSIVA</b>                              | <b>41.682</b>   | <b>893.646.939</b>    |             |
| <b>NETTOVERMÖGEN INSGESAMT</b>                    | <b>27.581.483</b>   | <b>12.735.369.286</b> |             |
| <b>Nettoinventarwert je Anteil</b>                |   |                       |             |
| 1D  | 22,07   |                       |             |
| <b>Anzahl der Anteile im Umlauf</b>               |   |                       |             |
| 1D  | 1.250.000   |                       |             |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstands-<br>kosten | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                      |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                      |                    |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                      |                    |                              |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.16   | 2.906.000   | EUR                | 2.905.792            | 2.906.087          | 0,17                         |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.22   | 2.180.000   | EUR                | 2.150.125            | 2.184.796          | 0,13                         |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.23   | 4.360.000   | EUR                | 4.259.320            | 4.349.667          | 0,26                         |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.24   | 4.360.000   | EUR                | 4.197.600            | 4.305.064          | 0,25                         |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.26   | 1.960.000   | EUR                | 1.818.324            | 1.882.658          | 0,11                         |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.27   | 11.900.000  | EUR                | 11.017.555           | 11.245.024         | 0,66                         |
| Austria 0,75% 16 - 20.10.26   | 56.700.000  | EUR                | 58.503.650           | 59.872.365         | 3,53                         |
| Austria 1,50% 16 - 20.02.47   | 1.220.000   | EUR                | 1.250.937            | 1.433.433          | 0,08                         |
| Austria 1,95% 12 - 18.06.19   | 300.000     | EUR                | 321.012              | 321.807            | 0,02                         |
| Austria 3,15% 12 - 20.06.44   | 361.000     | EUR                | 559.373              | 577.276            | 0,03                         |
| Austria 3,20% 10 - 20.02.17   | 1.924.000   | EUR                | 1.995.682            | 1.969.695          | 0,12                         |
| Austria 3,40% 12 - 22.11.22   | 9.806.000   | EUR                | 11.805.690           | 12.139.747         | 0,72                         |
| Austria 3,65% 11 - 20.04.22   | 800.000     | EUR                | 985.400              | 985.838            | 0,06                         |
| Austria 4,35% 08 - 15.03.19   | 1.229.000   | EUR                | 1.384.269            | 1.390.913          | 0,08                         |
|   |             |                    | <b>103.154.729</b>   | <b>105.564.370</b> | <b>6,22</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                      |                    |                              |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.21   | 2.900.000   | EUR                | 2.924.108            | 2.942.891          | 0,17                         |
| Belgium 1,00% 16 - 22.06.26   | 2.500.000   | EUR                | 2.657.789            | 2.688.200          | 0,16                         |
| Belgium 1,90% 15 - 22.06.38   | 1.794.000   | EUR                | 1.935.479            | 2.184.935          | 0,13                         |
| Belgium 3,00% 12 - 28.09.19   | 3.622.000   | EUR                | 4.003.890            | 4.041.780          | 0,24                         |
| Belgium 3,75% 13 - 22.06.45   | 3.592.000   | EUR                | 5.660.047            | 6.169.314          | 0,36                         |
| Belgium 4,00% 08 - 28.03.18   | 300.000     | EUR                | 323.499              | 323.917            | 0,02                         |
| Belgium 4,25% 12 - 28.09.22   | 17.248.500  | EUR                | 21.232.988           | 22.210.117         | 1,31                         |
|   |             |                    | <b>38.737.800</b>    | <b>40.561.154</b>  | <b>2,39</b>                  |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                      |                    |                              |
| Finland 1,50% 13 - 15.04.23   | 4.053.000   | EUR                | 4.289.290            | 4.530.101          | 0,27                         |
| Finland 1,875% 11 - 26.10.22  | 600.000     | EUR                | 611.557              | 611.796            | 0,03                         |
| Finland 2,75% 12 - 04.07.28   | 1.200.000   | EUR                | 1.468.205            | 1.563.389          | 0,09                         |
|   |             |                    | <b>6.369.052</b>     | <b>6.705.286</b>   | <b>0,39</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                      |                    |                              |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.05.20  | 4.003.000   | EUR                | 3.958.808            | 4.071.695          | 0,24                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.23  | 6.431.000   | EUR                | 6.379.442            | 6.479.040          | 0,38                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.24  | 644.000     | EUR                | 627.142              | 644.341            | 0,04                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.26  | 4.384.000   | EUR                | 3.964.779            | 4.289.700          | 0,25                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 15.05.30  | 1.300.000   | EUR                | 725.064              | 797.719            | 0,05                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.55  | 700.000     | EUR                | 615.491              | 636.573            | 0,04                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.55  | 10.100.000  | EUR                | 5.411.489            | 5.967.484          | 0,35                         |
| France OAT 1,00% 05 - 25.07.17  | 6.468.114   | EUR                | 6.803.724            | 6.622.379          | 0,39                         |
| France OAT 1,00% 15 - 25.11.25  | 1.498.000   | EUR                | 1.572.708            | 1.619.286          | 0,10                         |
| France OAT 1,75% 14 - 25.11.24  | 4.600.000   | EUR                | 5.144.834            | 5.273.932          | 0,31                         |
| France OAT 1,75% 16 - 25.05.66  | 56.000.000  | EUR                | 54.395.673           | 64.265.040         | 3,79                         |
| France OAT 1,80% 07 - 25.07.40  | 1.161.485   | EUR                | 1.744.173            | 1.842.986          | 0,11                         |
| France OAT 2,25% 12 - 25.10.22  | 9.419.000   | EUR                | 10.575.936           | 10.904.282         | 0,64                         |
| France OAT 2,50% 14 - 25.05.30  | 7.167.000   | EUR                | 8.269.838            | 9.176.107          | 0,54                         |
| France OAT 2,75% 12 - 25.10.27  | 5.144.000   | EUR                | 6.225.229            | 6.553.046          | 0,39                         |
| France OAT 3,00% 12 - 25.04.22  | 16.922.000  | EUR                | 19.998.300           | 20.183.663         | 1,19                         |
| France OAT 3,25% 13 - 25.05.45  | 16.381.000  | EUR                | 21.392.300           | 26.031.412         | 1,53                         |
| France OAT 3,40% 99 - 25.07.29  | 1.807.417   | EUR                | 2.937.211            | 2.849.122          | 0,17                         |
| France OAT 3,50% 10 - 25.04.20  | 22.491.000  | EUR                | 25.703.075           | 25.911.265         | 1,53                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Frankreich (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| France OAT 3,75% 07 - 25.04.17  | 32.041.000  | EUR                | 33.141.005         | 33.156.027         | 1,95                         |
| France OAT 3,75% 05 - 25.04.21  | 14.764.000  | EUR                | 17.718.524         | 17.724.536         | 1,04                         |
| France OAT 4,00% 10 - 25.04.60  | 734.000     | EUR                | 1.230.683          | 1.448.435          | 0,09                         |
| France OAT 4,25% 08 - 25.10.18  | 500.000     | EUR                | 554.896            | 555.631            | 0,03                         |
| France OAT 4,25% 07 - 25.10.23  | 5.671.000   | EUR                | 7.301.963          | 7.515.958          | 0,44                         |
| France OAT 4,75% 04 - 25.04.35  | 4.386.000   | EUR                | 7.183.224          | 7.599.249          | 0,45                         |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 8.809.000   | EUR                | 14.065.384         | 14.534.821         | 0,86                         |
| France OAT 5,75% 01 - 25.10.32  | 38.305.000  | EUR                | 65.042.762         | 69.848.719         | 4,12                         |
| French Treasury Note BTAN 0,45% 11 - 25.07.16   | 4.960.355   | EUR                | 5.060.859          | 4.974.988          | 0,29                         |
|   |             |                    | <b>337.744.516</b> | <b>361.477.436</b> | <b>21,31</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Bundesobligation 0,25% 13 - 13.04.18  | 4.400.000   | EUR                | 4.464.929          | 4.471.368          | 0,26                         |
| Bundesobligation 0,25% 15 - 16.10.20  | 5.395.000   | EUR                | 5.464.757          | 5.593.050          | 0,33                         |
| Bundesobligation 0,50% 12 - 07.04.17  | 500.000     | EUR                | 504.141            | 504.350            | 0,03                         |
| Bundesobligation 0,50% 12 - 13.10.17  | 3.300.000   | EUR                | 3.344.703          | 3.348.392          | 0,20                         |
| Bundesobligation 0,50% 13 - 23.02.18  | 5.082.000   | EUR                | 5.175.699          | 5.178.901          | 0,31                         |
| Bundesobligation 0,75% 12 - 24.02.17  | 500.000     | EUR                | 504.342            | 504.550            | 0,03                         |
| Bundesobligation 1,00% 13 - 12.10.18  | 1.900.000   | EUR                | 1.969.714          | 1.972.214          | 0,12                         |
| Bundesobligation 1,00% 14 - 22.02.19  | 1.000.000   | EUR                | 1.042.532          | 1.044.160          | 0,06                         |
| Bundesrepublik Deutschland 0,50% 16 - 15.02.26  | 4.173.000   | EUR                | 4.358.493          | 4.428.867          | 0,26                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,75% 12 - 04.07.22  | 3.300.000   | EUR                | 3.720.814          | 3.753.675          | 0,22                         |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50% 14 - 15.08.46  | 1.467.000   | EUR                | 2.111.854          | 2.355.351          | 0,14                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,75% 06 - 04.01.17  | 600.000     | EUR                | 613.400            | 613.428            | 0,04                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,75% 08 - 04.01.19  | 1.400.000   | EUR                | 1.554.376          | 1.555.949          | 0,09                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 06 - 04.07.16  | 8.900.000   | EUR                | 8.903.045          | 8.899.110          | 0,52                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 07 - 04.01.18  | 2.200.000   | EUR                | 2.354.331          | 2.355.938          | 0,14                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.17  | 3.752.000   | EUR                | 3.957.559          | 3.936.830          | 0,23                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.39  | 15.326.000  | EUR                | 26.209.489         | 29.039.524         | 1,71                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 08 - 25.04.53  | 7.100.000   | EUR                | 7.793.882          | 7.801.622          | 0,46                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,75% 98 - 04.07.28  | 300.000     | EUR                | 459.021            | 476.777            | 0,03                         |
| Bundesrepublik Deutschland 5,50% 00 - 04.01.31  | 8.991.000   | EUR                | 15.040.924         | 16.156.738         | 0,95                         |
| Bundesrepublik Deutschland 5,625% 98 - 04.01.28   | 4.724.000   | EUR                | 7.603.542          | 7.889.223          | 0,46                         |
| Bundesrepublik Deutschland 6,25% 94 - 04.01.24  | 74.175.000  | EUR                | 110.324.693        | 111.824.991        | 6,59                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Deutschland (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 6,50% 97 -<br>04.07.27   | 16.823.000  | EUR                | 27.620.577         | 29.290.640         | 1,73                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 -<br>10.03.17  | 450.000     | EUR                | 451.764            | 451.980            | 0,03                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 -<br>15.09.17  | 2.800.000   | EUR                | 2.818.764          | 2.821.940          | 0,17                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 -<br>15.12.17  | 1.500.000   | EUR                | 1.512.732          | 1.514.234          | 0,09                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 16 -<br>16.03.18  | 1.500.000   | EUR                | 1.515.175          | 1.516.875          | 0,09                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 16 -<br>15.06.18  | 600.000     | EUR                | 606.904            | 607.656            | 0,04                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.16  | 249.000     | EUR                | 249.006            | 249.000            | 0,01                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.18  | 1.317.000   | EUR                | 1.325.229          | 1.331.500          | 0,08                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.01.20  | 900.000     | EUR                | 913.243            | 915.687            | 0,05                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.21  | 4.005.000   | EUR                | 3.829.551          | 4.086.862          | 0,24                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.01.22  | 4.830.000   | EUR                | 4.860.304          | 4.925.199          | 0,29                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.23  | 1.425.000   | EUR                | 1.379.167          | 1.427.537          | 0,08                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.24  | 3.465.000   | EUR                | 3.291.435          | 3.463.060          | 0,20                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.25  | 823.000     | EUR                | 769.961            | 825.518            | 0,05                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 98 -<br>04.01.26  | 1.863.000   | EUR                | 1.760.894          | 1.865.944          | 0,11                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.26  | 1.475.000   | EUR                | 1.355.922          | 1.474.675          | 0,09                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 98 -<br>25.10.31  | 3.000.000   | EUR                | 2.983.140          | 2.991.330          | 0,18                         |
| Deutsche Bundesrepublik 0.01 – 97 - 04.01.17  | 1.242.000   | EUR                | 1.243.517          | 1.245.304          | 0,07                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked<br>Bond 0,50% 14 - 15.04.30                              | 963.177     | EUR                | 1.194.525          | 1.162.459          | 0,07                         |
|   |             |                    | <b>277.158.050</b> | <b>285.872.408</b> | <b>16,85</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Irland 2,00% 15 - 18.02.45  | 3.509.000   | EUR                | 3.535.793          | 4.131.586          | 0,24                         |
| Irland 2,40% 14 - 15.05.30  | 1.900.000   | EUR                | 2.270.158          | 2.290.754          | 0,13                         |
| Irland 4,50% 04 - 18.04.20  | 700.000     | EUR                | 822.619            | 825.744            | 0,05                         |
| Irland 5,90% 09 - 18.10.19  | 24.351.000  | EUR                | 29.768.562         | 29.286.003         | 1,73                         |
|   |             |                    | <b>36.397.132</b>  | <b>36.534.087</b>  | <b>2,15</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro Zero Coupon –<br>15 - 12.08.16                                    | 1.040.000   | EUR                | 1.040.054          | 1.040.281          | 0,06                         |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro Zero Coupon –<br>15 - 14.09.16                                    | 1.299.000   | EUR                | 1.299.110          | 1.299.753          | 0,08                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |            |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                 |            |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                 |            |                              |
| Italy Buoni Ordinari del Tesoro Zero Coupon –<br>16 - 04.07.18                                    | 11.000.000  | EUR                | 11.000.219      | 10.994.500 | 0,65                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,10% 16 -<br>15.04.19  | 4.200.000   | EUR                | 4.198.748       | 4.210.398  | 0,25                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,75% 14 -<br>15.01.18  | 7.761.000   | EUR                | 7.850.985       | 7.860.410  | 0,46                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,05% 14 -<br>01.12.19  | 5.000.000   | EUR                | 5.158.823       | 5.177.000  | 0,31                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,35% 15 -<br>15.04.22  | 500.000     | EUR                | 520.203         | 522.872    | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,45% 15 -<br>15.09.22  | 5.400.000   | EUR                | 5.631.182       | 5.668.977  | 0,33                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,00% 15 -<br>01.12.25  | 17.284.000  | EUR                | 18.484.097      | 18.429.698 | 1,09                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 11 -<br>15.09.16  | 7.487.620   | EUR                | 7.614.164       | 7.536.664  | 0,44                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,15% 14 -<br>15.12.21  | 3.496.000   | EUR                | 3.769.317       | 3.815.053  | 0,23                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,50% 14 -<br>01.12.24  | 13.320.000  | EUR                | 13.936.853      | 14.832.322 | 0,87                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,70% 16 -<br>01.03.47  | 12.500.000  | EUR                | 12.954.250      | 13.453.401 | 0,79                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 06 -<br>01.08.21  | 31.271.000  | EUR                | 35.548.247      | 36.588.477 | 2,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 07 -<br>01.02.17  | 2.000.000   | EUR                | 2.048.113       | 2.048.800  | 0,12                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 10 -<br>01.09.20  | 4.800.000   | EUR                | 5.556.576       | 5.562.325  | 0,33                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 05 -<br>01.02.37  | 2.000.000   | EUR                | 2.523.994       | 2.653.792  | 0,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 03 -<br>01.02.19  | 31.312.000  | EUR                | 34.697.477      | 34.763.609 | 2,05                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 09 -<br>01.09.19  | 17.309.000  | EUR                | 19.772.763      | 19.600.712 | 1,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 09 -<br>01.03.20  | 400.000     | EUR                | 459.724         | 460.880    | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 -<br>01.02.18  | 5.587.000   | EUR                | 5.987.253       | 5.990.487  | 0,35                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 -<br>01.03.19  | 2.000.000   | EUR                | 2.233.896       | 2.240.614  | 0,13                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 04 -<br>01.02.20  | 2.200.000   | EUR                | 2.544.741       | 2.547.028  | 0,15                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 12 -<br>01.06.17  | 17.283.000  | EUR                | 18.042.832      | 18.061.495 | 1,06                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 11 -<br>01.09.21  | 300.000     | EUR                | 365.589         | 366.856    | 0,02                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 11 -<br>01.03.22  | 7.900.000   | EUR                | 9.845.454       | 9.872.077  | 0,58                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 09 - 01.03.25   | 18.568.000  | EUR                | 23.780.571         | 24.469.111         | 1,44                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 09 - 01.09.40   | 4.000.000   | EUR                | 5.746.240          | 6.073.600          | 0,36                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 02 - 01.08.17   | 2.000.000   | EUR                | 2.114.294          | 2.116.360          | 0,13                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 98 - 01.11.29   | 400.000     | EUR                | 565.798            | 572.544            | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 - 01.11.22   | 1.975.000   | EUR                | 2.549.355          | 2.565.683          | 0,15                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,75% 02 - 01.02.33   | 11.354.000  | EUR                | 16.939.510         | 17.696.935         | 1,04                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,00% 00 - 01.05.31   | 4.700.000   | EUR                | 7.131.377          | 7.335.559          | 0,43                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 - 01.11.27   | 11.941.000  | EUR                | 17.957.296         | 18.147.334         | 1,07                         |
| Italy Certificati di Credito del Tesoro Zero Coupon – 14 - 30.08.16                               | 8.600.000   | EUR                | 8.602.421          | 8.602.322          | 0,51                         |
| Italy Certificati di Credito del Tesoro Zero Coupon – 15 - 30.08.17                               | 9.118.000   | EUR                | 9.118.798          | 9.133.029          | 0,54                         |
|   |             |                    | <b>327.590.324</b> | <b>332.310.958</b> | <b>19,59</b>                 |
| <b>Litauen</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Lithuania 3,375% 14 - 18.02.19  | 3.000.000   | EUR                | 3.701.670          | 3.696.900          | 0,22                         |
| Lithuania 7,375% 10 - 11.02.20  | 5.000.000   | USD                | 5.301.492          | 5.306.902          | 0,31                         |
|   |             |                    | <b>9.003.162</b>   | <b>9.003.802</b>   | <b>0,53</b>                  |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.23   | 1.500.000   | EUR                | 1.460.012          | 1.522.860          | 0,09                         |
| Netherlands Zero Coupon – 98 - 15.01.25   | 2.548.000   | EUR                | 2.280.615          | 2.537.757          | 0,15                         |
| Netherlands Zero Coupon – 98 - 15.01.26   | 1.193.000   | EUR                | 983.814            | 1.176.930          | 0,07                         |
| Netherlands Zero Coupon – 98 - 15.01.28   | 887.000     | EUR                | 767.698            | 862.182            | 0,05                         |
| Netherlands Zero Coupon – 98 - 15.01.28   | 139.000     | EUR                | 121.731            | 136.032            | 0,01                         |
| Netherlands 0,01 – 93 - 15.01.17  | 4.800.000   | EUR                | 4.807.395          | 4.813.488          | 0,28                         |
| Netherlands 0,50% 14 - 15.04.17   | 5.138.000   | EUR                | 5.197.457          | 5.182.187          | 0,31                         |
| Netherlands 1,75% 13 - 15.07.23   | 30.918.000  | EUR                | 32.914.299         | 35.364.704         | 2,08                         |
| Netherlands 2,50% 11 - 15.01.17   | 30.116.000  | EUR                | 31.239.929         | 30.615.022         | 1,80                         |
| Netherlands 2,75% 14 - 15.01.47   | 1.689.000   | EUR                | 2.416.013          | 2.766.049          | 0,16                         |
| Netherlands 3,25% 11 - 15.07.21   | 14.300.000  | EUR                | 16.965.573         | 17.008.181         | 1,00                         |
| Netherlands 3,50% 10 - 15.07.20   | 11.347.000  | EUR                | 13.005.898         | 13.224.263         | 0,78                         |
| Netherlands 4,00% 09 - 15.07.19   | 2.369.000   | EUR                | 2.688.218          | 2.700.573          | 0,16                         |
| Netherlands 4,50% 07 - 15.07.17   | 2.336.000   | EUR                | 2.516.199          | 2.459.349          | 0,15                         |
| Netherlands 5,50% 98 - 15.01.28   | 20.249.000  | EUR                | 30.551.420         | 32.874.995         | 1,94                         |
| Netherlands 7,50% 93 - 15.01.23   | 20.061.000  | EUR                | 30.925.644         | 30.473.098         | 1,80                         |
|   |             |                    | <b>178.841.915</b> | <b>183.717.670</b> | <b>10,83</b>                 |
| <b>Slowakei</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Slovakia 3,00% 13 - 28.02.23  | 778.000     | EUR                | 897.633            | 935.991            | 0,05                         |
| Slovakia 3,625% 14 - 22.01.24   | 450.000     | EUR                | 593.395            | 597.434            | 0,04                         |
| Slovakia 3,875% 13 - 16.01.29   | 350.000     | EUR                | 489.584            | 492.405            | 0,03                         |
| Slovakia 4,00% 10 - 27.04.20  | 650.000     | EUR                | 757.016            | 755.206            | 0,04                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Slowakei (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Slovakia 4,375% 07 - 15.04.17   | 650.000     | EUR                | 675.611           | 675.291           | 0,04                         |
|   |             |                    | <b>3.413.239</b>  | <b>3.456.327</b>  | <b>0,20</b>                  |
| <b>Slovenien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Slovenia 5,125% 11 - 30.03.26   | 5.042.000   | EUR                | 6.468.886         | 6.869.389         | 0,41                         |
| Slovenia 4,125% 14 - 30.08.16   | 14.000.000  | USD                | 13.127.373        | 13.250.828        | 0,78                         |
| Slovenia 4,125% 10 - 26.01.20   | 5.200.000   | EUR                | 5.952.900         | 5.971.325         | 0,35                         |
| Slovenia 4,375% 08 - 06.02.19   | 400.000     | EUR                | 447.291           | 447.040           | 0,03                         |
| Slovenia 4,375% 11 - 18.01.21   | 300.000     | EUR                | 356.667           | 357.405           | 0,02                         |
| Slovenia 5,25% 14 - 18.02.24  | 500.000     | USD                | 499.790           | 507.674           | 0,03                         |
| Slovenia 5,50% 12 - 26.10.22  | 8.000.000   | USD                | 8.164.203         | 8.177.942         | 0,48                         |
| Slovenia 5,85% 13 - 10.05.23  | 700.000     | USD                | 717.215           | 731.984           | 0,04                         |
|   |             |                    | <b>35.734.325</b> | <b>36.313.587</b> | <b>2,14</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.17   | 1.903.000   | EUR                | 1.902.258         | 1.904.123         | 0,11                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.17   | 428.000     | EUR                | 427.282           | 428.424           | 0,03                         |
| Spain Zero Coupon – 09 - 15.06.18   | 1.800.000   | EUR                | 1.799.809         | 1.803.042         | 0,11                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.19   | 2.998.000   | EUR                | 2.977.491         | 2.994.912         | 0,18                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.19   | 1.128.000   | EUR                | 1.115.582         | 1.122.777         | 0,07                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.20   | 300.000     | EUR                | 295.445           | 297.588           | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.20   | 1.861.000   | EUR                | 1.815.678         | 1.842.781         | 0,11                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.21   | 1.200.000   | EUR                | 1.167.082         | 1.181.364         | 0,07                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.21   | 1.861.000   | EUR                | 1.789.938         | 1.825.008         | 0,11                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.22   | 1.861.000   | EUR                | 1.751.323         | 1.791.250         | 0,11                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.23   | 1.871.000   | EUR                | 1.733.451         | 1.777.768         | 0,10                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.23   | 1.128.000   | EUR                | 1.036.831         | 1.058.267         | 0,06                         |
| Spain Zero Coupon – 13 - 31.10.23   | 1.100.000   | EUR                | 994.880           | 1.014.233         | 0,06                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.24   | 6.222.000   | EUR                | 5.632.538         | 5.770.158         | 0,34                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.24   | 5.394.000   | EUR                | 4.764.056         | 4.915.660         | 0,29                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.25   | 1.370.000   | EUR                | 1.188.794         | 1.231.562         | 0,07                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.25   | 3.049.000   | EUR                | 2.618.002         | 2.706.353         | 0,16                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.26   | 2.326.000   | EUR                | 1.951.458         | 2.026.365         | 0,12                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.26   | 1.861.000   | EUR                | 1.541.275         | 1.588.084         | 0,09                         |
| Spain 0,25% 15 - 30.04.18   | 10.826.000  | EUR                | 10.863.728        | 10.906.180        | 0,64                         |
| Spain 0,25% 16 - 31.01.19   | 25.600.000  | EUR                | 25.685.276        | 25.811.733        | 1,52                         |
| Spain 0,50% 14 - 31.10.17   | 15.404.000  | EUR                | 15.514.159        | 15.541.844        | 0,92                         |
| Spain 2,15% 15 - 31.10.25   | 11.050.000  | EUR                | 11.383.991        | 12.024.083        | 0,71                         |
| Spain 2,75% 14 - 31.10.24   | 10.200.000  | EUR                | 11.395.991        | 11.623.009        | 0,69                         |
| Spain 3,80% 06 - 31.01.17   | 2.200.000   | EUR                | 2.249.581         | 2.250.930         | 0,13                         |
| Spain 3,80% 14 - 30.04.24   | 1.600.000   | EUR                | 1.944.208         | 1.948.200         | 0,11                         |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 4.400.000   | EUR                | 4.780.278         | 4.787.729         | 0,28                         |
| Spain 4,50% 12 - 31.01.18   | 8.150.000   | EUR                | 8.742.420         | 8.750.807         | 0,52                         |
| Spain 4,65% 10 - 30.07.25   | 9.527.000   | EUR                | 12.016.840        | 12.441.095        | 0,73                         |
| Spain 4,90% 07 - 30.07.40   | 13.821.000  | EUR                | 19.284.631        | 20.994.168        | 1,24                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 4.104.000   | EUR                | 6.652.256         | 6.577.143         | 0,39                         |
| Spain 5,50% 02 - 30.07.17   | 1.500.000   | EUR                | 1.589.396         | 1.591.980         | 0,09                         |
| Spain 5,75% 01 - 30.07.32   | 19.446.000  | EUR                | 26.998.387        | 30.619.016        | 1,80                         |
| Spain 5,90% 11 - 30.07.26   | 12.498.000  | EUR                | 17.822.347        | 17.962.177        | 1,06                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten      | Marktwert            | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Spanien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                      |                      |                              |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 17.919.000  | EUR                | 25.610.453           | 27.201.150           | 1,60                         |
|   |             |                    | <b>239.037.115</b>   | <b>248.310.963</b>   | <b>14,64</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>1.593.181.359</b> | <b>1.649.828.048</b> | <b>97,24</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>1.593.181.359</b> | <b>1.649.828.048</b> | <b>97,24</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                      |                      |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.11.16  | 9.991.000   | EUR                | 9.989.117            | 9.992.798            | 0,59                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 12 - 01.05.17  | 500.000     | EUR                | 499.832              | 500.055              | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 12 - 01.11.17  | 2.808.000   | EUR                | 2.793.475            | 2.807.607            | 0,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.19  | 1.022.000   | EUR                | 1.012.506            | 1.016.308            | 0,06                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.05.20  | 816.000     | EUR                | 800.624              | 806.551              | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.22  | 1.085.000   | EUR                | 1.024.283            | 1.043.944            | 0,06                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.22  | 4.216.000   | EUR                | 3.950.881            | 4.026.870            | 0,24                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.24  | 1.216.000   | EUR                | 1.084.839            | 1.115.704            | 0,07                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.24  | 900.000     | EUR                | 759.672              | 818.586              | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.25  | 1.215.000   | EUR                | 1.052.108            | 1.089.746            | 0,06                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.25  | 715.000     | EUR                | 610.442              | 628.256              | 0,04                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.26  | 1.216.000   | EUR                | 1.016.586            | 1.048.508            | 0,06                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.26  | 1.000.000   | EUR                | 838.664              | 850.610              | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro Zero Coupon<br>- 12 - 08.02.33  | 400.000     | EUR                | 400.136              | 400.212              | 0,02                         |
|   |             |                    | <b>25.833.165</b>    | <b>26.145.755</b>    | <b>1,54</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>25.833.165</b>    | <b>26.145.755</b>    | <b>1,54</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>25.833.165</b>    | <b>26.145.755</b>    | <b>1,54</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>1.619.014.524</b> | <b>1.675.973.803</b> | <b>98,78</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                      | <b>1.697.467.507</b> | <b>100,05</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Austria 3,20% 10 - 20.02.17   | 3.270.000   | EUR                | 3.402.010          | 3.347.662          | 0,91                      |
|   |             |                    | <b>3.402.010</b>   | <b>3.347.662</b>   | <b>0,91</b>               |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Belgium 3,50% 11 - 28.06.17   | 1.900.000   | EUR                | 1.975.158          | 1.975.828          | 0,54                      |
|   |             |                    | <b>1.975.158</b>   | <b>1.975.828</b>   | <b>0,54</b>               |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Finland 4.375% 08 - 04.07.19  | 854.000     | EUR                | 978.099            | 981.820            | 0,27                      |
|   |             |                    | <b>978.099</b>     | <b>981.820</b>     | <b>0,27</b>               |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.02.18  | 8.000.000   | EUR                | 8.058.437          | 8.073.146          | 2,20                      |
| France OAT 0,25% 12 - 25.07.18  | 3.407.242   | EUR                | 3.582.187          | 3.510.992          | 0,96                      |
| France OAT 1,00% 14 - 25.05.19  | 6.376.000   | EUR                | 6.609.107          | 6.656.544          | 1,82                      |
| France OAT 4,25% 03 - 25.04.19  | 2.500.000   | EUR                | 2.831.166          | 2.837.665          | 0,77                      |
| French Treasury Note BTAN 1,00% 12 - 25.07.17   | 9.900.000   | EUR                | 10.057.107         | 10.060.999         | 2,74                      |
| French Treasury Note BTAN 1,75% 12 - 25.02.17   | 11.065.000  | EUR                | 11.327.324         | 11.228.762         | 3,06                      |
|   |             |                    | <b>42.465.328</b>  | <b>42.368.108</b>  | <b>11,55</b>              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.19   | 1.806.000   | EUR                | 1.820.702          | 1.836.630          | 0,50                      |
|   |             |                    | <b>1.820.702</b>   | <b>1.836.630</b>   | <b>0,50</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,10% 16 - 15.04.19   | 4.500.000   | EUR                | 4.502.057          | 4.511.140          | 1,23                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,75% 14 - 15.01.18   | 15.425.000  | EUR                | 15.611.502         | 15.622.578         | 4,26                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 - 01.06.18   | 4.645.000   | EUR                | 5.041.070          | 4.960.337          | 1,35                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 - 01.12.18   | 15.009.000  | EUR                | 16.222.299         | 16.287.717         | 4,44                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 - 01.02.18   | 7.488.000   | EUR                | 8.223.120          | 8.028.775          | 2,19                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 - 01.08.18   | 26.519.000  | EUR                | 29.543.322         | 29.024.584         | 7,92                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 02 - 01.08.17   | 43.818.000  | EUR                | 47.061.768         | 46.367.331         | 12,64                     |
|   |             |                    | <b>126.205.138</b> | <b>124.802.462</b> | <b>34,03</b>              |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.18   | 339.000     | EUR                | 339.963            | 341.875            | 0,09                      |
| Netherlands Zero Coupon – 15 - 15.04.18   | 33.478.000  | EUR                | 33.582.071         | 33.833.369         | 9,23                      |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.19   | 687.000     | EUR                | 689.014            | 694.530            | 0,19                      |
| Netherlands 0,50% 14 - 15.04.17   | 1.128.000   | EUR                | 1.136.856          | 1.137.701          | 0,31                      |
| Netherlands 1,25% 13 - 15.01.19   | 9.040.000   | EUR                | 9.444.886          | 9.463.614          | 2,58                      |
| Netherlands 3,50% 10 - 15.07.20   | 5.988.000   | EUR                | 6.960.092          | 6.978.662          | 1,90                      |
|   |             |                    | <b>52.152.882</b>  | <b>52.449.751</b>  | <b>14,30</b>              |
| <b>Slowakei</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Slovakia 4,00% 10 - 27.04.20  | 2.807.000   | EUR                | 3.298.281          | 3.261.328          | 0,89                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Slowakei (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Slovakia 4,625% 12 - 19.01.17   | 2.426.000   | EUR                | 2.489.542          | 2.488.348          | 0,68                      |
|   |             |                    | <b>5.787.823</b>   | <b>5.749.676</b>   | <b>1,57</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.17   | 10.000.000  | EUR                | 9.999.910          | 10.005.900         | 2,73                      |
| Spain Zero Coupon – 13 - 30.04.17   | 301.000     | EUR                | 300.593            | 300.648            | 0,08                      |
| Spain 2,10% 13 - 30.04.17   | 15.814.000  | EUR                | 16.264.640         | 16.117.945         | 4,39                      |
| Spain 2,75% 14 - 30.04.19   | 4.081.000   | EUR                | 4.406.650          | 4.402.026          | 1,20                      |
| Spain 3,75% 13 - 31.10.18   | 4.100.000   | EUR                | 4.463.741          | 4.470.990          | 1,22                      |
| Spain 4,00% 10 - 30.04.20   | 2.201.000   | EUR                | 2.485.826          | 2.533.160          | 0,69                      |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 4.388.000   | EUR                | 4.748.570          | 4.774.672          | 1,30                      |
| Spain 4,50% 12 - 31.01.18   | 21.950.000  | EUR                | 23.550.665         | 23.568.125         | 6,43                      |
| Spain 4,60% 09 - 30.07.19   | 3.490.000   | EUR                | 4.109.370          | 3.985.423          | 1,09                      |
| Spain 4,85% 10 - 31.10.20   | 35.600.000  | EUR                | 42.775.892         | 42.877.494         | 11,69                     |
| Spain 5,50% 11 - 30.04.21   | 5.000.000   | EUR                | 6.198.062          | 6.278.374          | 1,71                      |
|   |             |                    | <b>119.303.919</b> | <b>119.314.757</b> | <b>32,53</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>354.091.059</b> | <b>352.826.694</b> | <b>96,20</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>354.091.059</b> | <b>352.826.694</b> | <b>96,20</b>              |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 12 - 01.05.17  | 3.098.000   | EUR                | 3.079.418          | 3.098.341          | 0,85                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 98 - 01.11.21  | 7.300.000   | EUR                | 6.987.702          | 7.084.358          | 1,93                      |
|   |             |                    | <b>10.067.120</b>  | <b>10.182.699</b>  | <b>2,78</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>10.067.120</b>  | <b>10.182.699</b>  | <b>2,78</b>               |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>10.067.120</b>  | <b>10.182.699</b>  | <b>2,78</b>               |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>364.158.179</b> | <b>363.009.393</b> | <b>98,98</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>367.417.506</b> | <b>100,18</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.19   | 10.000.000  | EUR                | 9.807.036         | 10.072.200        | 2,11                         |
| Austria 3,65% 11 - 20.04.22   | 800.000     | EUR                | 985.400           | 985.838           | 0,21                         |
| Austria 4,35% 08 - 15.03.19   | 24.677.000  | EUR                | 28.487.375        | 27.928.047        | 5,87                         |
|   |             |                    | <b>39.279.811</b> | <b>38.986.085</b> | <b>8,19</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Belgium 3,00% 12 - 28.09.19   | 1.570.000   | EUR                | 1.762.936         | 1.751.959         | 0,37                         |
|   |             |                    | <b>1.762.936</b>  | <b>1.751.959</b>  | <b>0,37</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.18  | 4.384.000   | EUR                | 4.424.393         | 4.438.362         | 0,93                         |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.05.20  | 30.016.000  | EUR                | 30.250.758        | 30.531.102        | 6,42                         |
| France OAT 0,25% 12 - 25.07.18  | 2.147.840   | EUR                | 2.174.700         | 2.213.242         | 0,46                         |
| France OAT 0,25% 15 - 25.11.20  | 6.000.000   | EUR                | 6.162.196         | 6.172.644         | 1,30                         |
| France OAT 3,25% 11 - 25.10.21  | 1.200.000   | EUR                | 1.417.010         | 1.430.566         | 0,30                         |
| France OAT 3,75% 09 - 25.10.19  | 1.700.000   | EUR                | 1.933.482         | 1.940.159         | 0,41                         |
| France OAT 3,75% 05 - 25.04.21  | 6.262.000   | EUR                | 7.455.478         | 7.517.681         | 1,58                         |
| France OAT 4,25% 08 - 25.10.18  | 27.100.000  | EUR                | 31.208.503        | 30.115.170        | 6,33                         |
|   |             |                    | <b>85.026.520</b> | <b>84.358.926</b> | <b>17,73</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 - 15.12.17   | 1.000.000   | EUR                | 1.007.320         | 1.009.490         | 0,21                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.20   | 2.814.000   | EUR                | 2.816.569         | 2.866.903         | 0,60                         |
|   |             |                    | <b>3.823.889</b>  | <b>3.876.393</b>  | <b>0,81</b>                  |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Ireland 5,90% 09 - 18.10.19   | 15.715.000  | EUR                | 19.350.062        | 18.899.821        | 3,97                         |
|   |             |                    | <b>19.350.062</b> | <b>18.899.821</b> | <b>3,97</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 08 - 15.09.19   | 14.968.445  | EUR                | 16.571.974        | 16.300.637        | 3,43                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 - 01.06.18   | 6.319.000   | EUR                | 6.879.622         | 6.747.980         | 1,42                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 06 - 01.08.21   | 12.500.000  | EUR                | 14.521.010        | 14.625.562        | 3,07                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 10 - 01.09.20   | 18.586.000  | EUR                | 21.551.810        | 21.537.784        | 4,53                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 03 - 01.02.19   | 7.246.000   | EUR                | 8.190.340         | 8.044.747         | 1,69                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 09 - 01.03.20   | 16.500.000  | EUR                | 19.057.170        | 19.011.300        | 4,00                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 - 01.02.18   | 864.000     | EUR                | 964.609           | 926.397           | 0,19                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 - 01.03.19   | 4.008.000   | EUR                | 4.531.565         | 4.490.191         | 0,94                         |
|   |             |                    | <b>92.268.100</b> | <b>91.684.598</b> | <b>19,27</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 15 - 15.04.18   | 44.356.000  | EUR                | 44.628.238        | 44.826.839        | 9,42                         |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.21   | 567.000     | EUR                | 562.454           | 575.992           | 0,12                         |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.22   | 2.459.000   | EUR                | 2.412.781         | 2.494.459         | 0,52                         |
| Netherlands 0,25% 14 - 15.01.20   | 6.575.000   | EUR                | 6.725.513         | 6.765.701         | 1,42                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Niederlande (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Netherlands 0,50% 14 - 15.04.17   | 12.474.000  | EUR                | 12.570.846         | 12.581.276         | 2,64                         |
| Netherlands 1,25% 13 - 15.01.19   | 20.264.000  | EUR                | 21.193.037         | 21.213.571         | 4,46                         |
| Netherlands 4,00% 09 - 15.07.19   | 35.095.000  | EUR                | 40.230.492         | 40.007.012         | 8,41                         |
|   |             |                    | <b>128.323.361</b> | <b>128.464.850</b> | <b>26,99</b>                 |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.20   | 435.000     | EUR                | 422.915            | 431.503            | 0,09                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.21   | 2.277.000   | EUR                | 2.203.577          | 2.241.638          | 0,47                         |
| Spain 0,25% 15 - 30.04.18   | 2.700.000   | EUR                | 2.712.796          | 2.719.997          | 0,57                         |
| Spain 3,80% 14 - 30.04.24   | 14.000.000  | EUR                | 16.632.126         | 17.046.750         | 3,59                         |
| Spain 4,00% 10 - 30.04.20   | 13.652.000  | EUR                | 15.655.324         | 15.712.266         | 3,30                         |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 9.800.000   | EUR                | 10.707.965         | 10.663.579         | 2,24                         |
| Spain 4,30% 09 - 31.10.19   | 1.500.000   | EUR                | 1.692.431          | 1.714.780          | 0,36                         |
| Spain 4,60% 09 - 30.07.19   | 14.300.000  | EUR                | 16.361.917         | 16.329.956         | 3,43                         |
| Spain 4,85% 10 - 31.10.20   | 18.640.000  | EUR                | 22.230.064         | 22.450.463         | 4,72                         |
|   |             |                    | <b>88.619.115</b>  | <b>89.310.932</b>  | <b>18,77</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>458.453.794</b> | <b>457.333.564</b> | <b>96,10</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>458.453.794</b> | <b>457.333.564</b> | <b>96,10</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 12 - 01.11.17  | 6.511.000   | EUR                | 6.445.640          | 6.510.088          | 1,37                         |
|   |             |                    | <b>6.445.640</b>   | <b>6.510.088</b>   | <b>1,37</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>6.445.640</b>   | <b>6.510.088</b>   | <b>1,37</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>6.445.640</b>   | <b>6.510.088</b>   | <b>1,37</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>464.899.434</b> | <b>463.843.652</b> | <b>97,47</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>470.058.852</b> | <b>98,78</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Austria 0,75% 16 - 20.10.26   | 9.100.000   | EUR                | 9.444.881         | 9.609.145         | 3,44                         |
|   |             |                    | <b>9.444.881</b>  | <b>9.609.145</b>  | <b>3,44</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Belgium 2,60% 14 - 22.06.24   | 1.100.000   | EUR                | 1.308.698         | 1.333.735         | 0,47                         |
| Belgium 4,00% 06 - 28.03.22   | 1.736.000   | EUR                | 2.156.025         | 2.175.275         | 0,78                         |
|   |             |                    | <b>3.464.723</b>  | <b>3.509.010</b>  | <b>1,25</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.02.18  | 1.147.000   | EUR                | 1.155.471         | 1.157.487         | 0,41                         |
| France OAT 1,75% 14 - 25.11.24  | 5.500.000   | EUR                | 5.941.155         | 6.305.788         | 2,26                         |
| France OAT 3,25% 11 - 25.10.21  | 9.178.000   | EUR                | 10.724.844        | 10.941.445        | 3,91                         |
| France OAT 3,50% 10 - 25.04.20  | 1.054.000   | EUR                | 1.206.889         | 1.214.285         | 0,44                         |
| France OAT 3,75% 07 - 25.04.17  | 9.245.000   | EUR                | 9.734.189         | 9.566.726         | 3,42                         |
| France OAT 4,25% 08 - 25.10.18  | 6.478.000   | EUR                | 7.308.933         | 7.198.748         | 2,58                         |
|   |             |                    | <b>36.071.481</b> | <b>36.384.479</b> | <b>13,02</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesobligation 0,25% 13 - 13.04.18  | 1.047.000   | EUR                | 1.061.241         | 1.063.982         | 0,38                         |
| Bundesobligation 0,25% 15 - 16.10.20  | 1.346.000   | EUR                | 1.382.782         | 1.395.412         | 0,50                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 13 - 15.02.23  | 600.000     | EUR                | 668.231           | 678.646           | 0,24                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,75% 08 - 04.01.19  | 5.239.000   | EUR                | 5.801.361         | 5.822.582         | 2,09                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.01.23   | 3.707.000   | EUR                | 3.419.582         | 3.779.101         | 1,35                         |
|   |             |                    | <b>12.333.197</b> | <b>12.739.723</b> | <b>4,56</b>                  |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Ireland 3,40% 14 - 18.03.24   | 2.802.130   | EUR                | 3.443.229         | 3.457.362         | 1,24                         |
|   |             |                    | <b>3.443.229</b>  | <b>3.457.362</b>  | <b>1,24</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,35% 15 - 15.04.22   | 3.100.000   | EUR                | 3.208.961         | 3.241.806         | 1,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 10 - 01.03.21   | 12.270.000  | EUR                | 14.016.553        | 14.234.317        | 5,09                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 06 - 01.08.21   | 1.200.000   | EUR                | 1.393.031         | 1.404.054         | 0,50                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 03 - 01.02.19   | 3.117.000   | EUR                | 3.506.220         | 3.460.596         | 1,24                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 09 - 01.03.20   | 20.223.000  | EUR                | 23.520.776        | 23.300.941        | 8,34                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 08 - 01.08.23   | 8.509.000   | EUR                | 10.316.396        | 10.843.217        | 3,88                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 - 01.09.22   | 11.845.000  | EUR                | 15.271.609        | 15.347.945        | 5,49                         |
|   |             |                    | <b>71.233.546</b> | <b>71.832.876</b> | <b>25,70</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 12 - 15.07.22   | 1.079.000   | EUR                | 995.533           | 1.090.923         | 0,39                         |
| Netherlands 1,25% 13 - 15.01.19   | 13.000.000  | EUR                | 13.589.160        | 13.609.180        | 4,87                         |
| Netherlands 1,75% 13 - 15.07.23   | 7.028.000   | EUR                | 7.731.011         | 8.038.784         | 2,87                         |
| Netherlands 2,25% 12 - 15.07.22   | 15.780.000  | EUR                | 17.488.524        | 18.330.786        | 6,56                         |
| Netherlands 3,25% 11 - 15.07.21   | 1.941.000   | EUR                | 2.296.358         | 2.308.593         | 0,83                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Niederlande (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Netherlands 3,50% 10 - 15.07.20   | 2.401.000   | EUR                | 2.777.109          | 2.798.225          | 1,00                         |
| Netherlands 4,00% 09 - 15.07.19   | 38.260.000  | EUR                | 44.485.667         | 43.614.996         | 15,60                        |
| Netherlands 7,50% 93 - 15.01.23   | 1.585.000   | EUR                | 2.397.186          | 2.407.650          | 0,86                         |
|   |             |                    | <b>91.760.548</b>  | <b>92.199.137</b>  | <b>32,98</b>                 |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Spain 2,75% 14 - 31.10.24   | 20.000.000  | EUR                | 21.938.900         | 22.790.214         | 8,15                         |
| Spain 4,65% 10 - 30.07.25   | 4.331.000   | EUR                | 5.479.644          | 5.655.755          | 2,02                         |
| Spain 5,50% 11 - 30.04.21   | 2.664.000   | EUR                | 3.306.770          | 3.345.118          | 1,20                         |
| Spain 5,85% 11 - 31.01.22   | 7.500.000   | EUR                | 9.624.363          | 9.791.086          | 3,50                         |
|   |             |                    | <b>40.349.677</b>  | <b>41.582.173</b>  | <b>14,87</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>268.101.282</b> | <b>271.313.905</b> | <b>97,06</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>268.101.282</b> | <b>271.313.905</b> | <b>97,06</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 12 - 01.11.17  | 3.362.000   | EUR                | 3.316.365          | 3.361.530          | 1,20                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.25  | 500.000     | EUR                | 429.178            | 439.340            | 0,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.11.25  | 700.000     | EUR                | 595.383            | 609.938            | 0,22                         |
|   |             |                    | <b>4.340.926</b>   | <b>4.410.808</b>   | <b>1,58</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>4.340.926</b>   | <b>4.410.808</b>   | <b>1,58</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>4.340.926</b>   | <b>4.410.808</b>   | <b>1,58</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>272.442.208</b> | <b>275.724.713</b> | <b>98,64</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>280.283.139</b> | <b>100,27</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Austria 1,95% 12 - 18.06.19   | 1.000.000   | EUR                | 1.068.497         | 1.072.690         | 0,69                         |
|   |             |                    | <b>1.068.497</b>  | <b>1.072.690</b>  | <b>0,69</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Belgium 2,25% 13 - 22.06.23   | 8.000       | EUR                | 8.429             | 9.386             | 0,01                         |
| Belgium 2,60% 14 - 22.06.24   | 4.829.000   | EUR                | 5.749.302         | 5.855.098         | 3,76                         |
|   |             |                    | <b>5.757.731</b>  | <b>5.864.484</b>  | <b>3,77</b>                  |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Finland 2,00% 14 - 15.04.24   | 1.881.000   | EUR                | 2.112.025         | 2.187.080         | 1,41                         |
|   |             |                    | <b>2.112.025</b>  | <b>2.187.080</b>  | <b>1,41</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.05.20  | 7.300.000   | EUR                | 7.362.166         | 7.425.275         | 4,78                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.24  | 2.515.000   | EUR                | 2.362.380         | 2.516.333         | 1,62                         |
| France OAT 1,75% 13 - 25.05.23  | 26.612.000  | EUR                | 29.112.957        | 30.190.116        | 19,43                        |
| France OAT 2,25% 13 - 25.05.24  | 2.212.000   | EUR                | 2.503.055         | 2.620.999         | 1,69                         |
| France OAT 4,25% 08 - 25.10.18  | 6.478.000   | EUR                | 7.308.933         | 7.198.748         | 4,63                         |
|   |             |                    | <b>48.649.491</b> | <b>49.951.471</b> | <b>32,15</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 1,00% 15 - 15.08.25  | 2.309.000   | EUR                | 2.438.327         | 2.564.273         | 1,65                         |
|   |             |                    | <b>2.438.327</b>  | <b>2.564.273</b>  | <b>1,65</b>                  |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Ireland 5,40% 09 - 13.03.25   | 1.059.000   | EUR                | 1.460.806         | 1.500.934         | 0,97                         |
| Ireland 5,90% 09 - 18.10.19   | 16.000.000  | EUR                | 19.564.640        | 19.242.579        | 12,38                        |
|   |             |                    | <b>21.025.446</b> | <b>20.743.513</b> | <b>13,35</b>                 |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,45% 15 - 15.09.22   | 3.377.000   | EUR                | 3.485.841         | 3.545.210         | 2,28                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50% 15 - 01.06.25   | 8.593.000   | EUR                | 8.167.561         | 8.841.618         | 5,69                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 13 - 01.05.21   | 6.000.000   | EUR                | 6.961.953         | 6.977.000         | 4,49                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 10 - 01.09.20   | 2.000.000   | EUR                | 2.264.740         | 2.317.635         | 1,49                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 09 - 01.03.25   | 2.099.000   | EUR                | 2.761.331         | 2.766.085         | 1,78                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 - 01.11.27   | 700.000     | EUR                | 1.048.373         | 1.063.825         | 0,69                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 7,25% 97 - 01.11.26   | 2.650.000   | EUR                | 4.109.722         | 4.143.027         | 2,67                         |
|   |             |                    | <b>28.799.521</b> | <b>29.654.400</b> | <b>19,09</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.19   | 500.000     | EUR                | 499.172           | 505.480           | 0,33                         |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.21   | 4.000.000   | EUR                | 3.972.914         | 4.063.440         | 2,62                         |
| Netherlands Zero Coupon – 98 - 15.01.24   | 3.420.000   | EUR                | 3.247.686         | 3.438.194         | 2,21                         |
| Netherlands 3,75% 06 - 15.01.23   | 1.202.000   | EUR                | 1.500.427         | 1.528.449         | 0,98                         |
| Netherlands 7,50% 93 - 15.01.23   | 6.058.000   | EUR                | 9.154.254         | 9.202.235         | 5,92                         |
|   |             |                    | <b>18.374.453</b> | <b>18.737.798</b> | <b>12,06</b>                 |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Spain 2,75% 14 - 31.10.24   | 5.902.000   | EUR                | 6.478.271         | 6.725.392         | 4,33                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Spanien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Spain 3,80% 14 - 30.04.24   | 2.466.000   | EUR                | 2.937.122          | 3.002.663          | 1,93                         |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 319.000     | EUR                | 353.634            | 347.110            | 0,22                         |
| Spain 4,65% 10 - 30.07.25   | 4.700.000   | EUR                | 5.991.870          | 6.137.624          | 3,95                         |
| Spain 4,80% 08 - 31.01.24   | 1.625.000   | EUR                | 2.042.511          | 2.099.958          | 1,35                         |
| Spain 5,50% 11 - 30.04.21   | 440.000     | EUR                | 536.630            | 552.497            | 0,36                         |
|   |             |                    | <b>18.340.038</b>  | <b>18.865.244</b>  | <b>12,14</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>146.565.529</b> | <b>149.640.953</b> | <b>96,31</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>146.565.529</b> | <b>149.640.953</b> | <b>96,31</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.08.24  | 619.000     | EUR                | 539.719            | 563.005            | 0,36                         |
|   |             |                    | <b>539.719</b>     | <b>563.005</b>     | <b>0,36</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>539.719</b>     | <b>563.005</b>     | <b>0,36</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>539.719</b>     | <b>563.005</b>     | <b>0,36</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>147.105.248</b> | <b>150.203.958</b> | <b>96,67</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>151.924.264</b> | <b>97,78</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Finland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Finland 2,75% 12 - 04.07.28   | 2.000.000   | EUR                | 2.522.730         | 2.605.649         | 9,93                         |
|   |             |                    | <b>2.522.730</b>  | <b>2.605.649</b>  | <b>9,93</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.32  | 800.000     | EUR                | 610.369           | 721.168           | 2,75                         |
| France OAT 3,50% 10 - 25.04.26  | 5.000.000   | EUR                | 6.274.000         | 6.639.274         | 25,30                        |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 700.000     | EUR                | 1.067.766         | 1.154.998         | 4,40                         |
|   |             |                    | <b>7.952.135</b>  | <b>8.515.440</b>  | <b>32,45</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 1,75% 14 - 15.02.24  | 4.500.000   | EUR                | 5.126.410         | 5.243.058         | 19,98                        |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 98 - 04.01.26   | 492.000     | EUR                | 431.119           | 492.777           | 1,87                         |
|   |             |                    | <b>5.557.529</b>  | <b>5.735.835</b>  | <b>21,85</b>                 |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 10 - 01.09.20   | 3.847.000   | EUR                | 4.485.448         | 4.457.971         | 16,99                        |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 13 - 01.03.24   | 1.476.000   | EUR                | 1.856.572         | 1.860.870         | 7,09                         |
|   |             |                    | <b>6.342.020</b>  | <b>6.318.841</b>  | <b>24,08</b>                 |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Spain 4,50% 12 - 31.01.18   | 4.500.000   | EUR                | 4.822.407         | 4.831.734         | 18,41                        |
|   |             |                    | <b>4.822.407</b>  | <b>4.831.734</b>  | <b>18,41</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>27.196.821</b> | <b>28.007.499</b> | <b>106,72</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>27.196.821</b> | <b>28.007.499</b> | <b>106,72</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>27.196.821</b> | <b>28.007.499</b> | <b>106,72</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>28.287.848</b> | <b>107,79</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Austria 4,15% 07 - 15.03.37   | 600.000     | EUR                | 921.793           | 1.011.104         | 2,26                         |
|   |             |                    | <b>921.793</b>    | <b>1.011.104</b>  | <b>2,26</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Belgium 1,60% 16 - 22.06.47   | 5.000.000   | EUR                | 4.834.483         | 5.749.000         | 12,85                        |
| Belgium 5,00% 04 - 28.03.35   | 800.000     | EUR                | 1.290.548         | 1.416.364         | 3,17                         |
|   |             |                    | <b>6.125.031</b>  | <b>7.165.364</b>  | <b>16,02</b>                 |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Finland 2,625% 12 - 30.07.66  | 600.000     | EUR                | 850.510           | 904.726           | 2,02                         |
|   |             |                    | <b>850.510</b>    | <b>904.726</b>    | <b>2,02</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT 4,75% 04 - 25.04.35  | 4.300.000   | EUR                | 7.205.854         | 7.450.244         | 16,66                        |
|   |             |                    | <b>7.205.854</b>  | <b>7.450.244</b>  | <b>16,66</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50% 14 - 15.08.46  | 5.159.000   | EUR                | 7.262.948         | 8.283.064         | 18,51                        |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.39  | 1.300.000   | EUR                | 2.211.328         | 2.463.225         | 5,51                         |
|   |             |                    | <b>9.474.276</b>  | <b>10.746.289</b> | <b>24,02</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Ireland 2,00% 15 - 18.02.45   | 1.061.000   | EUR                | 1.022.168         | 1.249.249         | 2,79                         |
|   |             |                    | <b>1.022.168</b>  | <b>1.249.249</b>  | <b>2,79</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 13 - 01.09.44   | 1.700.000   | EUR                | 2.425.356         | 2.563.484         | 5,73                         |
|   |             |                    | <b>2.425.356</b>  | <b>2.563.484</b>  | <b>5,73</b>                  |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 98 - 15.01.24   | 500.000     | EUR                | 441.783           | 502.660           | 1,12                         |
|   |             |                    | <b>441.783</b>    | <b>502.660</b>    | <b>1,12</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.32   | 1.900.000   | EUR                | 1.266.796         | 1.383.998         | 3,09                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.33   | 1.800.000   | EUR                | 1.176.538         | 1.296.864         | 2,90                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.33   | 2.900.000   | EUR                | 1.856.361         | 2.054.592         | 4,59                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.34   | 1.800.000   | EUR                | 1.147.528         | 1.256.544         | 2,81                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.37   | 1.648.000   | EUR                | 916.582           | 1.027.330         | 2,30                         |
| Spain 3,45% 16 - 25.10.38   | 700.000     | EUR                | 751.713           | 812.532           | 1,82                         |
| Spain 4,70% 09 - 30.07.41   | 1.951.000   | EUR                | 2.666.039         | 2.905.412         | 6,49                         |
| Spain 4,90% 07 - 30.07.40   | 400.000     | EUR                | 542.012           | 607.602           | 1,36                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 747.000     | EUR                | 1.064.415         | 1.197.156         | 2,68                         |
|   |             |                    | <b>11.387.984</b> | <b>12.542.030</b> | <b>28,04</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>39.854.755</b> | <b>44.135.150</b> | <b>98,66</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>39.854.755</b> | <b>44.135.150</b> | <b>98,66</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 03 - 01.08.33  | 700.000     | EUR                | 453.492           | 484.379           | 1,08                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 03 - 01.02.34  | 400.000     | EUR                | 254.229           | 272.076           | 0,61                         |
|   |             |                    | <b>707.721</b>    | <b>756.455</b>    | <b>1,69</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>707.721</b>    | <b>756.455</b>    | <b>1,69</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>707.721</b>    | <b>756.455</b>    | <b>1,69</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>40.562.476</b> | <b>44.891.605</b> | <b>100,35</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>45.297.952</b> | <b>101,26</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+ UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Austria 3,80% 12 - 26.01.62   | 500.000     | EUR                | 955.853           | 1.001.806         | 1,78                         |
| Austria 4,15% 07 - 15.03.37   | 2.000.000   | EUR                | 2.986.519         | 3.370.347         | 5,97                         |
|   |             |                    | <b>3.942.372</b>  | <b>4.372.153</b>  | <b>7,75</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Belgium 2,15% 16 - 25.04.52   | 700.000     | EUR                | 848.928           | 860.293           | 1,53                         |
| Belgium 4,25% 10 - 28.03.41   | 100.000     | EUR                | 168.768           | 176.755           | 0,31                         |
|   |             |                    | <b>1.017.696</b>  | <b>1.037.048</b>  | <b>1,84</b>                  |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Finland 2,625% 12 - 04.07.42  | 1.700.000   | EUR                | 2.414.781         | 2.563.390         | 4,54                         |
|   |             |                    | <b>2.414.781</b>  | <b>2.563.390</b>  | <b>4,54</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 22.11.36  | 600.000     | EUR                | 387.196           | 422.334           | 0,75                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.40  | 2.000.000   | EUR                | 1.534.770         | 1.634.920         | 2,90                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.47  | 500.000     | EUR                | 287.531           | 318.045           | 0,56                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 22.06.66  | 700.000     | EUR                | 521.820           | 557.123           | 0,99                         |
| France OAT 1,50% 15 - 25.05.31  | 900.000     | EUR                | 966.296           | 1.027.981         | 1,82                         |
| France OAT 1,75% 16 - 25.05.66  | 9.700.000   | EUR                | 9.479.470         | 11.131.623        | 19,73                        |
| France OAT 2,50% 14 - 25.05.30  | 1.600.000   | EUR                | 1.939.638         | 2.048.524         | 3,63                         |
| France OAT 3,25% 13 - 25.05.45  | 5.499.000   | EUR                | 7.767.817         | 8.738.584         | 15,49                        |
| France OAT 4,00% 10 - 25.04.60  | 500.000     | EUR                | 916.133           | 986.672           | 1,75                         |
| France OAT 4,75% 04 - 25.04.35  | 400.000     | EUR                | 669.531           | 693.046           | 1,23                         |
|   |             |                    | <b>24.470.202</b> | <b>27.558.852</b> | <b>48,85</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50% 14 - 15.08.46  | 2.400.000   | EUR                | 3.712.553         | 3.853.335         | 6,83                         |
|   |             |                    | <b>3.712.553</b>  | <b>3.853.335</b>  | <b>6,83</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,25% 15 - 01.09.46   | 1.400.000   | EUR                | 1.573.981         | 1.685.511         | 2,99                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 14 - 01.03.30   | 1.500.000   | EUR                | 1.824.493         | 1.843.284         | 3,27                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 07 - 01.08.39   | 1.100.000   | EUR                | 1.627.548         | 1.670.187         | 2,96                         |
|   |             |                    | <b>5.026.022</b>  | <b>5.198.982</b>  | <b>9,22</b>                  |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands 0,25% 15 - 15.07.25   | 1.200.000   | EUR                | 1.201.335         | 1.230.398         | 2,18                         |
| Netherlands 2,75% 14 - 15.01.47   | 600.000     | EUR                | 942.812           | 982.610           | 1,74                         |
|   |             |                    | <b>2.144.147</b>  | <b>2.213.008</b>  | <b>3,92</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Spain 1,95% 15 - 30.07.30   | 1.048.000   | EUR                | 1.029.641         | 1.097.717         | 1,95                         |
| Spain 2,90% 16 - 31.10.46   | 1.100.000   | EUR                | 1.119.837         | 1.235.537         | 2,19                         |
| Spain 3,45% 16 - 30.07.66   | 500.000     | EUR                | 527.490           | 580.380           | 1,03                         |
| Spain 4,70% 09 - 30.07.41   | 500.000     | EUR                | 699.210           | 744.596           | 1,32                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 2.000.000   | EUR                | 2.626.220         | 3.205.235         | 5,68                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+ UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Spanien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 1.000.000   | EUR                | 1.457.950         | 1.518.006         | 2,69                         |
|   |             |                    | <b>7.460.348</b>  | <b>8.381.471</b>  | <b>14,86</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>50.188.121</b> | <b>55.178.239</b> | <b>97,81</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>50.188.121</b> | <b>55.178.239</b> | <b>97,81</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>50.188.121</b> | <b>55.178.239</b> | <b>97,81</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>55.568.504</b> | <b>98,50</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Australien</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Australia 1,25% 12 - 21.02.22   | 95.744      | AUD                | 73.723             | 72.936             | 0,01                         |
| Australia 2,50% 10 - 20.09.30   | 951.142     | AUD                | 874.183            | 920.423            | 0,14                         |
| Australia 4,00% 96 - 20.08.20   | 121.545     | AUD                | 128.966            | 152.879            | 0,02                         |
|   |             |                    | <b>1.076.872</b>   | <b>1.146.238</b>   | <b>0,17</b>                  |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Finland 2,75% 12 - 04.07.28   | 5.700.000   | EUR                | 7.173.222          | 7.426.099          | 1,10                         |
|   |             |                    | <b>7.173.222</b>   | <b>7.426.099</b>   | <b>1,10</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.17  | 4.347.000   | EUR                | 4.355.873          | 4.366.301          | 0,65                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.25  | 1.074.000   | EUR                | 997.720            | 1.059.845          | 0,16                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.27  | 1.574.000   | EUR                | 1.413.401          | 1.509.938          | 0,22                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.29  | 817.000     | EUR                | 688.954            | 774.745            | 0,11                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.41  | 1.317.000   | EUR                | 822.883            | 1.038.389          | 0,15                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.45  | 1.322.000   | EUR                | 743.486            | 955.978            | 0,14                         |
| France OAT 0,01 – 09 - 25.04.21   | 955.000     | EUR                | 951.714            | 970.910            | 0,14                         |
| France OAT 0,10% 12 - 25.07.21  | 4.254.457   | EUR                | 4.364.458          | 4.496.961          | 0,67                         |
| France OAT 0,10% 15 - 01.03.25  | 400.804     | EUR                | 424.688            | 431.041            | 0,06                         |
| France OAT 0,25% 12 - 25.07.18  | 2.129.136   | EUR                | 2.212.847          | 2.193.969          | 0,33                         |
| France OAT 0,25% 13 - 25.07.24  | 9.033.108   | EUR                | 9.733.960          | 9.892.608          | 1,47                         |
| France OAT 0,70% 14 - 25.07.30  | 1.593.101   | EUR                | 1.767.132          | 1.909.968          | 0,28                         |
| France OAT 1,00% 05 - 25.07.17  | 13.370.612  | EUR                | 13.910.195         | 13.689.501         | 2,03                         |
| France OAT 1,10% 10 - 25.07.22  | 19.155.235  | EUR                | 20.575.398         | 21.614.767         | 3,21                         |
| France OAT 1,30% 10 - 25.07.19  | 8.039.054   | EUR                | 8.676.419          | 8.641.581          | 1,28                         |
| France OAT 1,80% 07 - 25.07.40  | 8.372.989   | EUR                | 10.404.430         | 13.285.841         | 1,97                         |
| France OAT 1,85% 11 - 25.07.27  | 5.215.581   | EUR                | 6.242.963          | 6.781.038          | 1,01                         |
| France OAT 2,10% 08 - 25.07.23  | 4.301.166   | EUR                | 5.166.433          | 5.256.024          | 0,78                         |
| France OAT 2,25% 04 - 25.07.20  | 23.026.567  | EUR                | 26.002.636         | 26.250.286         | 3,90                         |
| France OAT 2,25% 12 - 25.10.22  | 2.570.000   | EUR                | 2.876.608          | 2.975.263          | 0,44                         |
| France OAT 3,15% 02 - 25.07.32  | 1.551.587   | EUR                | 2.459.322          | 2.539.638          | 0,38                         |
| France OAT 3,40% 99 - 25.07.29  | 1.524.147   | EUR                | 2.302.360          | 2.402.588          | 0,36                         |
| France OAT 4,00% 08 - 25.04.18  | 2.347.000   | EUR                | 2.538.017          | 2.541.374          | 0,38                         |
| France OAT 4,25% 07 - 25.10.17  | 5.200.000   | EUR                | 5.577.676          | 5.528.172          | 0,82                         |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 683.000     | EUR                | 1.072.151          | 1.126.948          | 0,17                         |
| French Treasury Note BTAN 0,45% 11 - 25.07.16   | 1.846.080   | EUR                | 1.880.630          | 1.851.526          | 0,27                         |
|   |             |                    | <b>138.162.354</b> | <b>144.085.200</b> | <b>21,38</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 13 - 15.02.23  | 5.400.000   | EUR                | 6.054.750          | 6.107.819          | 0,91                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,75% 12 - 04.07.22  | 2.104.000   | EUR                | 2.376.922          | 2.393.252          | 0,35                         |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50% 14 - 15.08.46  | 2.500.000   | EUR                | 3.628.500          | 4.013.891          | 0,59                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 07 - 04.01.18  | 5.137.000   | EUR                | 5.541.025          | 5.501.116          | 0,82                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.39  | 3.800.000   | EUR                | 6.482.268          | 7.200.195          | 1,07                         |
| Bundesrepublik Deutschland 5,50% 00 - 04.01.31  | 3.254.000   | EUR                | 5.508.091          | 5.847.406          | 0,87                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Deutschland (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0,75% 11 - 15.04.18                              | 1.805.196   | EUR                | 1.862.424         | 1.851.860         | 0,27                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10% 12 - 15.04.23                                 | 827.664     | EUR                | 883.792           | 892.180           | 0,13                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10% 15 - 15.04.26                                 | 5.032.736   | EUR                | 5.450.200         | 5.579.291         | 0,83                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10% 15 - 15.04.46                                 | 811.592     | EUR                | 1.046.083         | 1.067.081         | 0,16                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,50% 14 - 15.04.30                                 | 302.886     | EUR                | 357.285           | 365.553           | 0,05                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1,75% 09 - 15.04.20                                 | 7.783.772   | EUR                | 8.870.938         | 8.603.014         | 1,28                         |
|   |             |                    | <b>48.062.278</b> | <b>49.422.658</b> | <b>7,33</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,10% 16 - 15.05.22   | 5.942.598   | EUR                | 5.937.790         | 5.954.186         | 0,88                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,25% 15 - 15.05.18   | 3.650.000   | EUR                | 3.669.383         | 3.671.615         | 0,54                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,05% 14 - 01.12.19   | 1.700.000   | EUR                | 1.752.048         | 1.760.180         | 0,26                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,25% 15 - 15.09.32   | 9.881.091   | EUR                | 10.310.500        | 10.539.172        | 1,56                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,70% 13 - 15.09.18   | 10.110.291  | EUR                | 10.716.062        | 10.594.069        | 1,57                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 11 - 15.09.16   | 17.114.560  | EUR                | 17.231.166        | 17.226.660        | 2,56                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 06 - 15.09.17   | 1.574.669   | EUR                | 1.632.467         | 1.623.168         | 0,24                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 10 - 15.09.21   | 8.076.607   | EUR                | 9.035.549         | 9.024.801         | 1,34                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 08 - 15.09.19   | 2.388.005   | EUR                | 2.598.701         | 2.600.538         | 0,39                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 14 - 15.09.24   | 20.222.977  | EUR                | 23.101.296        | 23.412.140        | 3,47                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 04 - 15.09.35   | 6.648.309   | EUR                | 8.094.707         | 8.456.316         | 1,26                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,55% 09 - 15.09.41   | 1.897.611   | EUR                | 2.423.877         | 2.499.723         | 0,37                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,60% 07 - 15.09.23   | 7.906.469   | EUR                | 9.181.356         | 9.310.263         | 1,38                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,10% 11 - 15.09.26   | 4.766.880   | EUR                | 5.892.769         | 5.964.797         | 0,89                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 10 - 01.03.21   | 14.000.000  | EUR                | 16.182.320        | 16.241.274        | 2,41                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 07 - 01.02.17   | 4.000.000   | EUR                | 4.097.488         | 4.097.600         | 0,61                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 05 - 01.02.37   | 908.000     | EUR                | 1.150.604         | 1.204.822         | 0,18                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |               |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 12 - 01.06.17   | 12.000.000    | EUR                | 12.648.120         | 12.540.528         | 1,86                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 03 - 01.08.34   | 10.000.000    | EUR                | 14.629.600         | 14.668.700         | 2,18                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 - 01.11.22   | 5.300.000     | EUR                | 6.895.618          | 6.885.124          | 1,02                         |
| Italy Certificati di Credito del Tesoro Zero Coupon – 15 - 30.08.17                               | 6.400.000     | EUR                | 6.400.704          | 6.410.549          | 0,95                         |
|   |               |                    | <b>173.582.125</b> | <b>174.686.225</b> | <b>25,92</b>                 |
| <b>Japan</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| Japan Government Five Year Bond 0,20% 14 - 20.09.19   | 150.000.000   | JPY                | 1.210.184          | 1.337.220          | 0,20                         |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 - 15.09.17  | 2.000.000.000 | JPY                | 16.419.278         | 17.633.583         | 2,62                         |
|   |               |                    | <b>17.629.462</b>  | <b>18.970.803</b>  | <b>2,82</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| Spain Zero Coupon – 13 - 31.01.18   | 819.000       | EUR                | 813.587            | 815.020            | 0,12                         |
| Spain Zero Coupon – 14 - 31.01.19   | 824.000       | EUR                | 815.436            | 816.938            | 0,12                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.22   | 388.000       | EUR                | 363.202            | 377.489            | 0,06                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.26   | 1.000.000     | EUR                | 803.546            | 853.350            | 0,13                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.27   | 1.000.000     | EUR                | 777.239            | 831.810            | 0,12                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.28   | 1.000.000     | EUR                | 749.922            | 811.000            | 0,12                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.29   | 1.000.000     | EUR                | 723.451            | 791.720            | 0,12                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.30   | 1.000.000     | EUR                | 698.303            | 770.950            | 0,11                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.31   | 1.150.000     | EUR                | 771.314            | 862.282            | 0,13                         |
| Spain 0,50% 14 - 31.10.17   | 1.152.000     | EUR                | 1.157.668          | 1.162.309          | 0,17                         |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 5.700.000     | EUR                | 6.268.233          | 6.202.286          | 0,92                         |
| Spain 4,85% 10 - 31.10.20   | 5.300.000     | EUR                | 6.350.089          | 6.383.447          | 0,95                         |
| Spain 5,40% 13 - 31.01.23   | 1.780.000     | EUR                | 2.307.699          | 2.337.372          | 0,35                         |
| Spain 5,50% 11 - 30.04.21   | 4.200.000     | EUR                | 5.208.126          | 5.273.834          | 0,78                         |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 2.529.000     | EUR                | 3.679.215          | 3.839.037          | 0,57                         |
| Spain Inflation Linked Bond 0,55% 14 - 30.11.19   | 4.213.190     | EUR                | 4.366.236          | 4.357.702          | 0,65                         |
| Spain Inflation Linked Bond 1,00% 15 - 30.11.30   | 3.507.197     | EUR                | 3.421.333          | 3.661.513          | 0,54                         |
| Spain Inflation Linked Bond 1,80% 14 - 30.11.24   | 400.208       | EUR                | 436.057            | 448.233            | 0,07                         |
|   |               |                    | <b>39.710.656</b>  | <b>40.596.292</b>  | <b>6,03</b>                  |
| <b>Schweden</b>   |               |                    |                    |                    |                              |
| Sweden Inflation Linked Bond 0,50% 10 - 01.06.17  | 10.418.190    | SEK                | 1.202.920          | 1.174.212          | 0,18                         |
| Sweden Inflation Linked Bond 3,50% 99 - 01.12.28  | 9.000.000     | SEK                | 1.607.861          | 1.899.805          | 0,28                         |
| Sweden Inflation Linked Bond 4,00% 95 - 01.12.20  | 23.888.709    | SEK                | 4.029.388          | 4.138.243          | 0,61                         |
|   |               |                    | <b>6.840.169</b>   | <b>7.212.260</b>   | <b>1,07</b>                  |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |               |                    |                    |                    |                              |
| Network Rail Infrastructure Finance PLC 1,125% 07 - 22.11.47                                      | 251.374       | GBP                | 572.151            | 547.254            | 0,08                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------|-------------|--------------------|----------------|-----------|------------------------------|
|--------------|-------------|--------------------|----------------|-----------|------------------------------|

**Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren**

**Anleihen (Fortsetzung)**

**Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)**

|   |           |     |                   |                   |             |
|---|-----------|-----|-------------------|-------------------|-------------|
| Network Rail Infrastructure Finance PLC<br>1,375% 07 - 22.11.37 | 1.567.285 | GBP | 3.130.900         | 2.992.387         | 0,45        |
| Network Rail Infrastructure Finance PLC<br>1,75% 07 - 22.11.27  | 9.692.629 | GBP | 17.216.589        | 15.847.812        | 2,35        |
| United Kingdom Gilt 4,25% 06 - 07.12.27                         | 4.400.000 | GBP | 7.818.523         | 7.090.841         | 1,05        |
| United Kingdom Gilt 4,25% 03 - 07.03.36                         | 7.000.000 | GBP | 12.042.571        | 12.151.281        | 1,80        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125%<br>16 - 30.07.21    | 7.887.110 | GBP | 12.518.407        | 12.812.868        | 1,90        |
|   |           |     | <b>53.299.141</b> | <b>51.442.443</b> | <b>7,63</b> |

**Vereinigte Staaten**

|  |            |     |            |            |      |
|--|------------|-----|------------|------------|------|
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 14 - 15.04.19 | 6.974.994  | USD | 6.432.394  | 6.411.090  | 0,95 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 14 - 15.07.24 | 769.722    | USD | 698.534    | 699.816    | 0,10 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,25% 15 - 15.01.25  | 11.472.590 | USD | 10.183.403 | 10.484.153 | 1,56 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,375% 13 - 15.07.23 | 274.463    | USD | 249.692    | 255.439    | 0,04 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,625% 11 - 15.07.21 | 3.818.917  | USD | 2.923.097  | 3.617.772  | 0,54 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,625% 13 - 15.02.43 | 3.588.685  | USD | 2.825.448  | 3.144.102  | 0,47 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,75% 15 - 15.02.45  | 5.447.202  | USD | 4.538.784  | 4.924.073  | 0,73 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,375% 08 - 15.07.18 | 8.727.335  | USD | 6.553.621  | 8.239.019  | 1,22 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,375% 10 - 15.01.20 | 11.595.817 | USD | 10.127.061 | 11.144.338 | 1,65 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,375% 14 - 15.02.44 | 8.103.823  | USD | 7.845.495  | 8.432.466  | 1,25 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,75% 08 - 15.01.28  | 11.207.749 | USD | 10.978.368 | 11.794.155 | 1,75 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,875% 09 - 15.07.19 | 6.276.425  | USD | 5.570.797  | 6.112.754  | 0,91 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,00% 06 - 15.01.26  | 2.233.402  | USD | 2.306.643  | 2.365.020  | 0,35 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,125% 09 - 15.01.19 | 2.280.808  | USD | 2.247.240  | 2.202.458  | 0,33 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,125% 10 - 15.02.40 | 526.837    | USD | 488.974    | 619.965    | 0,09 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,125% 11 - 15.02.41 | 8.355.691  | USD | 8.428.548  | 9.921.643  | 1,47 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,375% 04 - 15.01.25 | 11.177.052 | USD | 11.717.429 | 12.012.578 | 1,78 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,50% 06 - 15.07.16  | 15.683.574 | USD | 12.927.693 | 14.149.261 | 2,10 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,50% 09 - 15.01.29  | 5.965.534  | USD | 6.559.535  | 6.803.655  | 1,01 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>3,375% 01 - 15.04.32                                    | 1.231.834   | USD                | 1.546.626          | 1.623.832          | 0,24                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>3,875% 99 - 15.04.29                                    | 5.151.373   | USD                | 5.476.549          | 6.678.597          | 0,99                         |
|   |             |                    | <b>120.625.931</b> | <b>131.636.186</b> | <b>19,53</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>606.162.210</b> | <b>626.624.404</b> | <b>92,98</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>606.162.210</b> | <b>626.624.404</b> | <b>92,98</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>     |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Kanada</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Canada 1,50% 10 - 01.12.44  | 111.042     | CAD                | 94.823             | 101.651            | 0,02                         |
| Canada 3,00% 03 - 01.12.36  | 249.272     | CAD                | 259.259            | 266.214            | 0,04                         |
|   |             |                    | <b>354.082</b>     | <b>367.865</b>     | <b>0,06</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.11.16  | 1.107.000   | EUR                | 1.106.229          | 1.107.199          | 0,17                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.19  | 1.445.000   | EUR                | 1.422.074          | 1.436.951          | 0,21                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 06 - 01.08.21  | 1.083.000   | EUR                | 1.048.494          | 1.061.264          | 0,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.11.21  | 827.000     | EUR                | 789.472            | 802.571            | 0,12                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 08 - 01.08.23  | 1.882.000   | EUR                | 1.723.661          | 1.774.105          | 0,26                         |
|   |             |                    | <b>6.089.930</b>   | <b>6.182.090</b>   | <b>0,92</b>                  |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Japanese Government CPI Linked Bond 0,10%<br>14 - 10.09.24  | 298.500.000 | JPY                | 2.437.409          | 2.786.887          | 0,41                         |
| Japanese Government CPI Linked Bond 1,10%<br>06 - 10.12.16  | 252.067.200 | JPY                | 1.997.915          | 2.258.186          | 0,33                         |
| Japanese Government CPI Linked Bond 1,20%<br>07 - 10.06.17  | 361.200.000 | JPY                | 2.913.531          | 3.292.789          | 0,49                         |
| Japanese Government CPI Linked Bond 1,20%<br>07 - 10.12.17  | 248.217.600 | JPY                | 2.021.405          | 2.282.219          | 0,34                         |
| Japanese Government CPI Linked Bond 1,40%<br>08 - 10.03.18  | 101.800.000 | JPY                | 847.919            | 949.373            | 0,14                         |
| Japanese Government CPI Linked Bond 1,40%<br>08 - 10.06.18  | 149.996.800 | JPY                | 1.252.222          | 1.399.521          | 0,21                         |
|   |             |                    | <b>11.470.401</b>  | <b>12.968.975</b>  | <b>1,92</b>                  |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 13 - 15.04.18                                    | 5.826.374   | USD                | 5.168.512          | 5.322.350          | 0,79                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten                | Marktwert                      | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------------------|--------------------------------|------------------------------|
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                                |                                |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                                |                                |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                                |                                |                              |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,75% 12 - 15.02.42   | 6.597.756   | USD                | 5.517.440<br><b>10.685.952</b> | 5.950.520<br><b>11.272.870</b> | 0,88<br><b>1,67</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>28.600.365</b>              | <b>30.791.800</b>              | <b>4,57</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>28.600.365</b>              | <b>30.791.800</b>              | <b>4,57</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>634.762.575</b>             | <b>657.416.204</b>             | <b>97,55</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                                | <b>662.437.639</b>             | <b>98,30</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EURO INFLATION-LINKED UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale<br>1,50% 11 - 25.07.21                                 | 3.030.219   | EUR                | 3.136.323          | 3.369.906          | 0,90                         |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale<br>1,50% 12 - 25.07.24                                 | 149.396     | EUR                | 176.828            | 176.180            | 0,05                         |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale<br>1,85% 06 - 25.07.17                                 | 48.922      | EUR                | 51.009             | 50.145             | 0,01                         |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale<br>1,85% 04 - 25.07.19                                 | 4.101.988   | EUR                | 4.245.895          | 4.442.412          | 1,18                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.28  | 1.400.000   | EUR                | 1.259.748          | 1.332.814          | 0,35                         |
| France OAT 0,10% 12 - 25.07.21  | 4.132.150   | EUR                | 4.394.734          | 4.367.683          | 1,16                         |
| France OAT 0,10% 15 - 01.03.25  | 3.808.246   | EUR                | 4.061.736          | 4.095.540          | 1,09                         |
| France OAT 0,25% 12 - 25.07.18  | 3.986.026   | EUR                | 4.150.280          | 4.107.401          | 1,09                         |
| France OAT 0,25% 13 - 25.07.24  | 11.132.520  | EUR                | 11.769.287         | 12.191.779         | 3,24                         |
| France OAT 0,70% 14 - 25.07.30  | 4.211.196   | EUR                | 4.390.878          | 5.048.803          | 1,34                         |
| France OAT 1,00% 05 - 25.07.17  | 9.319.393   | EUR                | 9.716.243          | 9.541.660          | 2,54                         |
| France OAT 1,10% 10 - 25.07.22  | 758.709     | EUR                | 856.438            | 856.127            | 0,23                         |
| France OAT 1,30% 10 - 25.07.19  | 1.944.657   | EUR                | 2.151.700          | 2.090.409          | 0,56                         |
| France OAT 1,80% 07 - 25.07.40  | 4.370.158   | EUR                | 6.329.996          | 6.934.348          | 1,85                         |
| France OAT 1,85% 11 - 25.07.27  | 7.364.618   | EUR                | 9.157.258          | 9.575.109          | 2,55                         |
| France OAT 2,10% 08 - 25.07.23  | 10.711.134  | EUR                | 13.045.505         | 13.089.006         | 3,48                         |
| France OAT 3,00% 12 - 25.04.22  | 1.045.000   | EUR                | 1.232.215          | 1.246.421          | 0,33                         |
| France OAT 3,15% 02 - 25.07.32  | 10.203.908  | EUR                | 14.011.467         | 16.701.757         | 4,45                         |
| France OAT 3,40% 99 - 25.07.29  | 7.121.876   | EUR                | 10.822.993         | 11.226.569         | 2,99                         |
| France OAT 4,00% 08 - 25.04.18  | 1.056.000   | EUR                | 1.162.603          | 1.143.456          | 0,30                         |
| France OAT 4,75% 04 - 25.04.35  | 4.500.000   | EUR                | 7.143.135          | 7.796.768          | 2,08                         |
| SNCF Reseau 2,45% 03 - 28.02.23   | 152.444     | EUR                | 184.592            | 181.028            | 0,05                         |
|   |             |                    | <b>113.450.863</b> | <b>119.565.321</b> | <b>31,82</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Bundesobligation 0,50% 13 - 23.02.18  | 4.100.000   | EUR                | 4.169.329          | 4.178.177          | 1,11                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,00% 15 -<br>15.08.25   | 1.200.000   | EUR                | 1.302.328          | 1.332.667          | 0,36                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 13 -<br>15.05.23   | 1.100.000   | EUR                | 1.231.327          | 1.249.152          | 0,33                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,25% 09 -<br>04.01.20   | 2.600.000   | EUR                | 2.946.328          | 2.959.859          | 0,79                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,75% 06 -<br>04.01.17   | 1.354.000   | EUR                | 1.413.576          | 1.384.302          | 0,37                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 06 -<br>04.07.16   | 229.000     | EUR                | 234.608            | 228.977            | 0,06                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 -<br>04.07.39   | 4.587.000   | EUR                | 7.450.241          | 8.691.393          | 2,31                         |
| Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked<br>Bond 0,75% 11 - 15.04.18                           | 14.228.130  | EUR                | 14.603.886         | 14.595.927         | 3,89                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 -<br>16.06.17  | 833.000     | EUR                | 835.615            | 838.101            | 0,22                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 -<br>15.12.17  | 4.100.000   | EUR                | 4.130.825          | 4.138.907          | 1,10                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.01.17  | 1.476.000   | EUR                | 1.479.007          | 1.479.926          | 0,39                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Deutschland (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10% 12 - 15.04.23                                 | 13.430.918  | EUR                | 14.228.700        | 14.477.858        | 3,85                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10% 15 - 15.04.46                                 | 2.418.616   | EUR                | 2.645.898         | 3.179.996         | 0,85                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,50% 14 - 15.04.30                                 | 3.222.707   | EUR                | 3.738.324         | 3.889.485         | 1,04                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1,75% 09 - 15.04.20                                 | 10.906.694  | EUR                | 12.094.679        | 12.054.624        | 3,21                         |
|   |             |                    | <b>72.504.671</b> | <b>74.679.351</b> | <b>19,88</b>                 |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,25% 15 - 15.09.32   | 2.095.989   | EUR                | 2.203.568         | 2.235.582         | 0,60                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,45% 15 - 15.09.22   | 3.515.000   | EUR                | 3.647.285         | 3.690.084         | 0,98                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,70% 13 - 15.09.18   | 1.414.168   | EUR                | 1.499.238         | 1.481.836         | 0,39                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 11 - 15.09.16   | 1.516.778   | EUR                | 1.546.428         | 1.526.713         | 0,41                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 06 - 15.09.17   | 2.903.150   | EUR                | 3.036.116         | 2.992.567         | 0,80                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 10 - 15.09.21   | 4.680.773   | EUR                | 5.232.344         | 5.230.296         | 1,39                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,15% 14 - 15.12.21   | 1.597.000   | EUR                | 1.724.823         | 1.742.746         | 0,46                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 08 - 15.09.19   | 1.327.284   | EUR                | 1.458.597         | 1.445.412         | 0,38                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 14 - 15.09.24   | 702.884     | EUR                | 815.511           | 813.729           | 0,22                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 04 - 15.09.35   | 1.433.340   | EUR                | 1.778.525         | 1.823.137         | 0,49                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,50% 14 - 01.12.24   | 913.000     | EUR                | 997.796           | 1.016.660         | 0,27                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,55% 09 - 15.09.41   | 6.399.553   | EUR                | 7.478.364         | 8.430.131         | 2,24                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,60% 07 - 15.09.23   | 2.281.480   | EUR                | 2.673.116         | 2.686.557         | 0,72                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,10% 11 - 15.09.26   | 4.344.442   | EUR                | 5.386.640         | 5.436.200         | 1,45                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 10 - 01.03.21   | 3.000.000   | EUR                | 3.460.922         | 3.480.273         | 0,93                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 05 - 01.02.37   | 4.600.000   | EUR                | 5.906.961         | 6.103.721         | 1,62                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 12 - 01.05.17   | 11.982.000  | EUR                | 13.058.026        | 12.475.059        | 3,32                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 11 - 01.09.21   | 909.000     | EUR                | 1.101.681         | 1.111.574         | 0,30                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 13 - 01.09.28   | 10.944.000  | EUR                | 14.722.420        | 14.815.841        | 3,94                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EURO INFLATION-LINKED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 13 -<br>01.09.44  | 500.000     | EUR                | 716.976            | 753.966            | 0,20                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 -<br>01.11.27  | 5.000.000   | EUR                | 7.510.862          | 7.598.749          | 2,02                         |
|   |             |                    | <b>85.956.199</b>  | <b>86.890.833</b>  | <b>23,13</b>                 |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.32   | 1.800.000   | EUR                | 1.236.118          | 1.330.452          | 0,35                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.32   | 3.875.000   | EUR                | 2.604.463          | 2.822.627          | 0,75                         |
| Spain 0,75% 16 - 01.05.25   | 14.000.000  | EUR                | 14.184.534         | 14.356.220         | 3,82                         |
| Spain 2,75% 14 - 30.04.19   | 1.400.000   | EUR                | 1.507.051          | 1.510.129          | 0,40                         |
| Spain 3,80% 14 - 30.04.24   | 8.439.000   | EUR                | 10.016.106         | 10.275.537         | 2,73                         |
| Spain 4,65% 10 - 30.07.25   | 2.000.000   | EUR                | 2.536.169          | 2.611.755          | 0,70                         |
| Spain 4,85% 10 - 31.10.20   | 15.000.000  | EUR                | 17.904.083         | 18.066.360         | 4,81                         |
| Spain 5,40% 13 - 31.01.23   | 942.000     | EUR                | 1.210.038          | 1.236.969          | 0,33                         |
| Spain 5,75% 01 - 30.07.32   | 9.000.000   | EUR                | 13.488.641         | 14.171.097         | 3,77                         |
| Spain Inflation Linked Bond 0,55% 14 -<br>30.11.19  | 5.437.826   | EUR                | 5.561.111          | 5.624.344          | 1,50                         |
| Spain Inflation Linked Bond 1,00% 15 -<br>30.11.30  | 1.183.367   | EUR                | 1.196.222          | 1.235.435          | 0,33                         |
| Spain Inflation Linked Bond 1,80% 14 -<br>30.11.24  | 8.319.324   | EUR                | 9.276.918          | 9.317.643          | 2,48                         |
|   |             |                    | <b>80.721.454</b>  | <b>82.558.568</b>  | <b>21,97</b>                 |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125%<br>16 - 22.11.36  | 703.262     | GBP                | 1.105.695          | 1.142.472          | 0,30                         |
|   |             |                    | <b>1.105.695</b>   | <b>1.142.472</b>   | <b>0,30</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>353.738.882</b> | <b>364.836.545</b> | <b>97,10</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>353.738.882</b> | <b>364.836.545</b> | <b>97,10</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 98 - 01.11.20  | 2.555.000   | EUR                | 2.488.380          | 2.510.824          | 0,67                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.08.27  | 1.816.000   | EUR                | 1.471.835          | 1.499.417          | 0,40                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 03 - 01.02.34  | 829.000     | EUR                | 549.959            | 563.878            | 0,15                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EURO INFLATION-LINKED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten             | Marktwert                   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                             |                             |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                             |                             |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                             |                             |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Inflation<br>Linked Zero Coupon – 04 - 15.09.16                             | 300.330     | EUR                | 302.770<br><b>4.812.944</b> | 300.642<br><b>4.874.761</b> | 0,08<br><b>1,30</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>4.812.944</b>            | <b>4.874.761</b>            | <b>1,30</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>4.812.944</b>            | <b>4.874.761</b>            | <b>1,30</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>358.551.826</b>          | <b>369.711.306</b>          | <b>98,40</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                             | <b>373.313.270</b>          | <b>99,36</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II EONIA UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.27   | 2.500.000   | EUR                | 2.283.937         | 2.369.375         | 0,38                         |
| Austria 0,75% 16 - 20.10.26   | 8.900.000   | EUR                | 9.129.832         | 9.397.955         | 1,52                         |
| Austria 2,40% 13 - 04.01.31   | 500.000     | EUR                | 642.285           | 655.991           | 0,11                         |
| Austria 3,40% 12 - 22.11.22   | 778.000     | EUR                | 939.879           | 963.158           | 0,16                         |
| Austria 4,30% 07 - 28.09.19   | 700.000     | EUR                | 740.864           | 740.859           | 0,12                         |
|   |             |                    | <b>13.736.797</b> | <b>14.127.338</b> | <b>2,29</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Belgium Zero Coupon – 10 - 15.09.20   | 800.000     | EUR                | 810.397           | 814.128           | 0,13                         |
| Belgium 1,00% 16 - 22.06.26   | 800.000     | EUR                | 850.015           | 860.224           | 0,14                         |
| Belgium 2,15% 16 - 22.06.66   | 3.000.000   | EUR                | 3.338.352         | 3.686.970         | 0,60                         |
| Belgium 4,00% 06 - 28.03.22   | 1.405.000   | EUR                | 1.724.090         | 1.760.519         | 0,28                         |
|   |             |                    | <b>6.722.854</b>  | <b>7.121.841</b>  | <b>1,15</b>                  |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Finland 0,375% 14 - 01.06.21  | 900.000     | EUR                | 927.034           | 932.175           | 0,15                         |
| Finland 3,50% 11 - 15.04.21   | 13.900.000  | EUR                | 16.402.447        | 16.526.613        | 2,68                         |
|   |             |                    | <b>17.329.481</b> | <b>17.458.788</b> | <b>2,83</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Caisse Francaise de Financement Local 1,80%<br>07 - 09.05.17                                      | 380.000.000 | JPY                | 2.837.780         | 3.383.956         | 0,55                         |
| Cie de Financement Foncier SA 0,375% 14 -<br>17.09.19   | 2.000.000   | EUR                | 2.016.700         | 2.037.330         | 0,33                         |
| Cie de Financement Foncier SA 2,00% 10 -<br>20.12.17  | 20.000.000  | CHF                | 19.021.093        | 19.177.540        | 3,11                         |
| Cie de Financement Foncier SA 2,375% 05 -<br>24.08.18   | 10.635.000  | CHF                | 10.329.856        | 10.471.519        | 1,70                         |
| Cie de Financement Foncier SA 3,75% 05 -<br>24.01.17  | 2.000.000   | EUR                | 2.142.940         | 2.044.400         | 0,33                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 15.09.17  | 900.000     | EUR                | 884.134           | 896.508           | 0,14                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.18  | 2.000.000   | EUR                | 2.019.318         | 2.024.800         | 0,33                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.19  | 800.000     | EUR                | 807.212           | 812.376           | 0,13                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.22  | 800.000     | EUR                | 809.032           | 811.832           | 0,13                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 23.05.34  | 600.000     | EUR                | 601.736           | 607.842           | 0,10                         |
| France OAT 1,00% 14 - 25.05.19  | 1.364.000   | EUR                | 1.416.191         | 1.424.016         | 0,23                         |
| France OAT 2,25% 13 - 25.05.24  | 800.000     | EUR                | 936.394           | 947.920           | 0,15                         |
| France OAT 3,00% 12 - 25.04.22  | 2.566.000   | EUR                | 3.026.693         | 3.060.589         | 0,50                         |
| France OAT 3,25% 11 - 25.10.21  | 4.115.000   | EUR                | 4.847.213         | 4.905.649         | 0,79                         |
| France OAT 3,75% 05 - 25.04.21  | 800.000     | EUR                | 956.373           | 960.419           | 0,16                         |
| France OAT 4,00% 10 - 25.04.60  | 1.050.000   | EUR                | 1.619.342         | 2.072.012         | 0,34                         |
| France OAT 4,25% 07 - 25.10.23  | 2.419.000   | EUR                | 3.144.496         | 3.205.978         | 0,52                         |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 2.620.000   | EUR                | 4.100.769         | 4.322.991         | 0,70                         |
| France OAT 5,75% 01 - 25.10.32  | 3.000.000   | EUR                | 5.091.098         | 5.470.465         | 0,89                         |
|   |             |                    | <b>66.608.370</b> | <b>68.638.142</b> | <b>11,13</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesobligation 0,25% 14 - 11.10.19  | 2.800.000   | EUR                | 2.869.868         | 2.883.475         | 0,47                         |
| Bundesobligation 0,50% 13 - 23.02.18  | 2.900.000   | EUR                | 2.949.399         | 2.955.296         | 0,48                         |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50% 14 -<br>15.08.46   | 2.400.000   | EUR                | 3.457.267         | 3.853.335         | 0,62                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,00% 10 -<br>04.07.20   | 757.000     | EUR                | 860.540           | 868.018           | 0,14                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II EONIA UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Deutschland (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 3,50% 09 - 04.07.19  | 5.100.000   | EUR                | 5.738.459         | 5.740.699         | 0,93                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,75% 08 - 04.01.19  | 4.900.000   | EUR                | 5.434.219         | 5.445.820         | 0,88                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 07 - 04.01.18  | 2.400.000   | EUR                | 2.566.408         | 2.570.114         | 0,42                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 05 - 04.01.37  | 600.000     | EUR                | 1.034.850         | 1.058.793         | 0,17                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.17  | 3.700.000   | EUR                | 3.879.661         | 3.882.269         | 0,63                         |
| Bundesrepublik Deutschland 5,625% 98 - 04.01.28   | 7.025.000   | EUR                | 10.960.437        | 11.731.963        | 1,90                         |
| Bundesrepublik Deutschland 6,25% 94 - 04.01.24  | 1.000.000   | EUR                | 1.489.423         | 1.507.583         | 0,24                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 - 16.06.17   | 2.000.000   | EUR                | 2.010.443         | 2.012.248         | 0,33                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.23   | 4.100.000   | EUR                | 4.109.472         | 4.107.298         | 0,67                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 98 - 04.07.28   | 1.100.000   | EUR                | 1.075.449         | 1.096.821         | 0,18                         |
| KFW 5,75% 01 - 07.06.32   | 5.300.000   | GBP                | 10.850.153        | 9.988.342         | 1,62                         |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 7,625% 93 - 01.02.23  | 4.500.000   | USD                | 5.116.474         | 5.191.033         | 0,84                         |
|   |             |                    | <b>64.402.522</b> | <b>64.893.107</b> | <b>10,52</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| GE Capital European Funding Unlimited Co. 1,00% 13 - 02.05.17                                     | 10.131.000  | EUR                | 10.255.003        | 10.223.699        | 1,66                         |
| German Postal Pensions Securitisation 2 PLC 4.375% 06 - 18.01.22                                  | 15.600.000  | EUR                | 19.796.556        | 19.409.103        | 3,14                         |
|   |             |                    | <b>30.051.559</b> | <b>29.632.802</b> | <b>4,80</b>                  |
| <b>Isle of Man</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Isle of Man 5.625% 00 - 29.03.30  | 2.000.000   | GBP                | 3.515.611         | 3.307.449         | 0,54                         |
|   |             |                    | <b>3.515.611</b>  | <b>3.307.449</b>  | <b>0,54</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Intesa Sanpaolo SpA 5,00% 12 - 27.01.21   | 2.450.000   | EUR                | 3.045.644         | 3.004.113         | 0,49                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,10% 16 - 15.04.19   | 31.300.000  | EUR                | 31.298.724        | 31.377.486        | 5,09                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,30% 15 - 15.10.18   | 900.000     | EUR                | 903.766           | 907.920           | 0,15                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,45% 16 - 25.10.21   | 5.900.000   | EUR                | 5.906.820         | 5.941.005         | 0,96                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,70% 15 - 01.05.20   | 6.000.000   | EUR                | 6.110.351         | 6.130.835         | 0,99                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,15% 14 - 15.05.17   | 3.000.000   | EUR                | 3.034.272         | 3.035.070         | 0,49                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,65% 15 - 01.03.32   | 4.800.000   | EUR                | 4.593.116         | 4.763.106         | 0,77                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 14 - 01.03.30   | 117.000     | EUR                | 128.800           | 143.776           | 0,02                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II EONIA UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert    | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|----------------|--------------------|-------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |                |                    |                   |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |                |                    |                   |                    |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |                |                    |                   |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 10 - 01.03.21   | 13.900.000     | EUR                | 16.096.916        | 16.125.265         | 2,62                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 - 01.08.18   | 900.000        | EUR                | 982.179           | 985.034            | 0,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 08 - 01.08.23   | 3.541.000      | EUR                | 4.410.882         | 4.512.379          | 0,73                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 - 01.09.22   | 5.752.000      | EUR                | 7.411.049         | 7.453.050          | 1,21                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 - 01.11.22   | 3.800.000      | EUR                | 4.875.949         | 4.936.504          | 0,80                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,00% 00 - 01.05.31   | 1.300.000      | EUR                | 1.958.211         | 2.028.985          | 0,33                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 - 01.11.27   | 1.232.000      | EUR                | 1.746.693         | 1.872.332          | 0,30                         |
| Italy Government International Bond 5,125% 04 - 31.07.24  | 2.147.000      | EUR                | 2.677.245         | 2.773.129          | 0,45                         |
|   |                |                    | <b>95.180.617</b> | <b>95.989.989</b>  | <b>15,56</b>                 |
| <b>Japan</b>  |                |                    |                   |                    |                              |
| Japan Government Ten Year Bond 1,70% 06 - 20.09.16  | 10.000.000.000 | JPY                | 78.715.002        | 88.098.600         | 14,29                        |
| Japan Government Twenty Year Bond 1,00% 15 - 20.12.35   | 1.500.000.000  | JPY                | 13.161.907        | 15.543.777         | 2,52                         |
|   |                |                    | <b>91.876.909</b> | <b>103.642.377</b> | <b>16,81</b>                 |
| <b>Luxemburg</b>  |                |                    |                   |                    |                              |
| Commerzbank Finance & Covered Bond SA FRN 07 - 20.03.17   | 8.200.000      | USD                | 7.322.033         | 7.280.544          | 1,18                         |
| European Financial Stability Facility 1,125% 12 - 30.11.17  | 900.000        | EUR                | 923.904           | 919.422            | 0,15                         |
| European Financial Stability Facility 3,875% 12 - 30.03.32  | 898.000        | EUR                | 1.234.454         | 1.345.382          | 0,22                         |
| Luxembourg 3,375% 10 - 18.05.20   | 752.000        | EUR                | 868.071           | 865.171            | 0,14                         |
|   |                |                    | <b>10.348.462</b> | <b>10.410.519</b>  | <b>1,69</b>                  |
| <b>Niederlande</b>  |                |                    |                   |                    |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.21   | 900.000        | EUR                | 907.920           | 914.274            | 0,15                         |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.22   | 1.100.000      | EUR                | 1.106.788         | 1.115.862          | 0,18                         |
| Netherlands Zero Coupon – 05 - 15.01.33   | 1.200.000      | EUR                | 1.048.713         | 1.119.876          | 0,18                         |
| Netherlands 3,25% 11 - 15.07.21   | 7.089.000      | EUR                | 8.341.561         | 8.431.538          | 1,37                         |
|   |                |                    | <b>11.404.982</b> | <b>11.581.550</b>  | <b>1,88</b>                  |
| <b>Slowakei</b>   |                |                    |                   |                    |                              |
| Slovakia 4,625% 12 - 19.01.17   | 591.000        | EUR                | 626.525           | 606.189            | 0,10                         |
|   |                |                    | <b>626.525</b>    | <b>606.189</b>     | <b>0,10</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |                |                    |                   |                    |                              |
| Kutxabank SA 1,75% 14 - 27.05.21  | 600.000        | EUR                | 629.027           | 646.524            | 0,10                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.23   | 900.000        | EUR                | 834.331           | 855.153            | 0,14                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.31   | 1.300.000      | EUR                | 915.019           | 989.001            | 0,16                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.35   | 1.400.000      | EUR                | 841.264           | 943.292            | 0,15                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.35   | 2.500.000      | EUR                | 1.453.735         | 1.623.725          | 0,26                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.36   | 1.400.000      | EUR                | 809.125           | 902.888            | 0,15                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.36   | 2.500.000      | EUR                | 1.403.841         | 1.586.225          | 0,26                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II EONIA UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Spanien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.37   | 1.000.000   | EUR                | 572.606            | 623.380            | 0,10                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.38   | 2.500.000   | EUR                | 1.289.234          | 1.473.950          | 0,24                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.39   | 2.500.000   | EUR                | 1.236.494          | 1.421.400          | 0,23                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.40   | 800.000     | EUR                | 383.638            | 441.720            | 0,07                         |
| Spain Zero Coupon – 10 - 30.07.41   | 1.500.000   | EUR                | 704.892            | 819.870            | 0,13                         |
| Spain 4,50% 12 - 31.01.18   | 2.500.000   | EUR                | 2.678.541          | 2.684.297          | 0,44                         |
| Spain 4,60% 09 - 30.07.19   | 4.500.000   | EUR                | 5.122.231          | 5.138.797          | 0,83                         |
| Spain 4,90% 07 - 30.07.40   | 2.909.000   | EUR                | 4.046.422          | 4.418.785          | 0,72                         |
| Spain 5,50% 02 - 30.07.17   | 4.000.000   | EUR                | 4.243.257          | 4.245.280          | 0,69                         |
| Spain 5,50% 11 - 30.04.21   | 3.800.000   | EUR                | 4.708.640          | 4.771.564          | 0,77                         |
| Spain 5,75% 01 - 30.07.32   | 1.200.000   | EUR                | 1.827.370          | 1.889.480          | 0,31                         |
|   |             |                    | <b>33.699.667</b>  | <b>35.475.331</b>  | <b>5,75</b>                  |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| EUROFIMA 5,50% 01 - 07.06.32  | 25.600.000  | GBP                | 44.117.651         | 44.438.982         | 7,21                         |
| European Investment Bank 3,50% 12 - 15.04.27  | 4.500.000   | EUR                | 5.945.885          | 6.058.663          | 0,98                         |
| European Investment Bank 3,625% 12 - 14.03.42   | 12.500.000  | EUR                | 18.157.500         | 20.495.459         | 3,32                         |
| European Investment Bank 4,00% 10 - 15.04.30  | 11.400.000  | EUR                | 15.561.288         | 16.746.365         | 2,72                         |
| European Investment Bank 4,50% 09 - 15.10.25  | 20.500.000  | EUR                | 27.720.971         | 28.923.827         | 4,69                         |
| European Union 2,875% 12 - 04.04.28   | 5.116.000   | EUR                | 6.237.223          | 6.589.118          | 1,07                         |
|   |             |                    | <b>117.740.518</b> | <b>123.252.414</b> | <b>19,99</b>                 |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Tennessee Valley Authority 5,35% 98 - 07.06.21  | 5.350.000   | GBP                | 8.931.247          | 7.688.480          | 1,25                         |
|   |             |                    | <b>8.931.247</b>   | <b>7.688.480</b>   | <b>1,25</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>572.176.121</b> | <b>593.826.316</b> | <b>96,29</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>572.176.121</b> | <b>593.826.316</b> | <b>96,29</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>     |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon – 98 - 01.11.19   | 1.300.000   | EUR                | 1.285.250          | 1.290.224          | 0,21                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon – 98 - 25.10.24   | 1.100.000   | EUR                | 958.100            | 970.915            | 0,16                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon – 02 - 01.02.27   | 1.700.000   | EUR                | 1.393.932          | 1.421.693          | 0,23                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon – 02 - 01.02.28   | 1.300.000   | EUR                | 1.029.913          | 1.060.436          | 0,17                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon – 02 - 01.08.29   | 1.600.000   | EUR                | 1.216.377          | 1.258.176          | 0,20                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II EONIA UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten               | Marktwert                     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                               |                               |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                               |                               |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                               |                               |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.02.30  | 2.600.000   | EUR                | 1.945.897<br><b>7.829.469</b> | 2.015.338<br><b>8.016.782</b> | 0,33<br><b>1,30</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>7.829.469</b>              | <b>8.016.782</b>              | <b>1,30</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>7.829.469</b>              | <b>8.016.782</b>              | <b>1,30</b>                  |
| <b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>   |             |                    |                               |                               |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                               |                               |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                               |                               |                              |
| UniCredit Bank Austria AG 7,25% 97 -<br>15.02.17  | 1.100.000   | USD                | 1.039.675<br><b>1.039.675</b> | 1.016.135<br><b>1.016.135</b> | 0,16<br><b>0,16</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>1.039.675</b>              | <b>1.016.135</b>              | <b>0,16</b>                  |
| <b>Summe – Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>                                     |             |                    | <b>1.039.675</b>              | <b>1.016.135</b>              | <b>0,16</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>581.045.265</b>            | <b>602.859.233</b>            | <b>97,75</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                               | <b>608.222.239</b>            | <b>98,62</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® EUROPE UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Austria 3,90% 04 - 15.07.20   | 622.000     | EUR                | 727.600           | 732.421           | 2,13                         |
|   |             |                    | <b>727.600</b>    | <b>732.421</b>    | <b>2,13</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.02.18  | 1.000.000   | EUR                | 1.006.710         | 1.009.143         | 2,94                         |
| France OAT 3,75% 07 - 25.04.17  | 566.000     | EUR                | 597.323           | 585.697           | 1,70                         |
|   |             |                    | <b>1.604.033</b>  | <b>1.594.840</b>  | <b>4,64</b>                  |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale<br>6,25% 01 - 01.06.31   | 2.200.000   | EUR                | 3.403.312         | 3.368.697         | 9,79                         |
|   |             |                    | <b>3.403.312</b>  | <b>3.368.697</b>  | <b>9,79</b>                  |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Ireland 4,40% 08 - 18.06.19   | 458.000     | EUR                | 516.890           | 522.190           | 1,52                         |
|   |             |                    | <b>516.890</b>    | <b>522.190</b>    | <b>1,52</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro Zero Coupon –<br>15 - 14.07.16  | 492.000     | EUR                | 492.003           | 492.030           | 1,43                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,50% 14 -<br>01.05.19  | 3.000.000   | EUR                | 3.205.770         | 3.210.196         | 9,34                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 14 -<br>01.09.24  | 2.850.000   | EUR                | 3.420.701         | 3.447.008         | 10,02                        |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 04 -<br>01.02.20  | 2.600.000   | EUR                | 3.000.018         | 3.010.124         | 8,75                         |
|   |             |                    | <b>10.118.492</b> | <b>10.159.358</b> | <b>29,54</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 05 - 15.01.30   | 1.000       | EUR                | 901               | 949               | 0,00                         |
|   |             |                    | <b>901</b>        | <b>949</b>        | <b>0,00</b>                  |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| United Kingdom Gilt 1,75% 12 - 07.09.22   | 3.923.000   | GBP                | 4.573.200         | 5.062.823         | 14,72                        |
| United Kingdom Gilt 2,50% 15 - 22.07.65   | 3.000.000   | GBP                | 4.124.366         | 4.822.482         | 14,02                        |
| United Kingdom Gilt 3,50% 13 - 22.07.68   | 1.600.000   | GBP                | 2.865.113         | 3.332.069         | 9,69                         |
| United Kingdom Gilt 4,25% 05 - 07.12.55   | 2.000.000   | GBP                | 3.930.845         | 4.341.144         | 12,62                        |
|   |             |                    | <b>15.493.524</b> | <b>17.558.518</b> | <b>51,05</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>31.864.752</b> | <b>33.936.973</b> | <b>98,67</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>31.864.752</b> | <b>33.936.973</b> | <b>98,67</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>31.864.752</b> | <b>33.936.973</b> | <b>98,67</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>34.175.086</b> | <b>99,36</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016

(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Austria Zero Coupon – 97 - 15.07.19   | 4.000.000   | EUR                | 3.925.500         | 4.028.880         | 1,17                      |
| Austria 3,80% 12 - 26.01.62   | 562.000     | EUR                | 887.921           | 1.126.030         | 0,33                      |
| Oesterreichische Kontrollbank AG 5,75% 99 - 07.12.28  | 6.800.000   | GBP                | 11.528.671        | 11.649.385        | 3,40                      |
|   |             |                    | <b>16.342.092</b> | <b>16.804.295</b> | <b>4,90</b>               |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.17   | 505.000     | EUR                | 505.729           | 506.975           | 0,15                      |
| Belgium Zero Coupon – 10 - 28.03.37   | 1.000.000   | EUR                | 667.524           | 828.230           | 0,24                      |
| Belgium 3,75% 13 - 22.06.45   | 5.832.000   | EUR                | 8.728.463         | 10.016.547        | 2,92                      |
|   |             |                    | <b>9.901.716</b>  | <b>11.351.752</b> | <b>3,31</b>               |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Caisse Francaise de Financement Local 1,80% 07 - 09.05.17   | 126.000.000 | JPY                | 935.292           | 1.122.048         | 0,33                      |
| Caisse Francaise de Financement Local 5,50% 01 - 16.07.26   | 6.200.000   | GBP                | 9.759.482         | 9.692.032         | 2,82                      |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.17  | 530.000     | EUR                | 530.737           | 532.353           | 0,16                      |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.17  | 6.075.000   | EUR                | 6.100.236         | 6.119.530         | 1,78                      |
| France OAT 3,25% 13 - 25.05.45  | 3.499.000   | EUR                | 4.942.694         | 5.560.339         | 1,62                      |
| France OAT 3,75% 09 - 25.10.19  | 1.900.000   | EUR                | 2.161.739         | 2.168.413         | 0,63                      |
|   |             |                    | <b>24.430.180</b> | <b>25.194.715</b> | <b>7,34</b>               |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 05 - 04.01.37  | 1.000.000   | EUR                | 1.486.448         | 1.764.655         | 0,51                      |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.39  | 7.000.000   | EUR                | 12.090.750        | 13.263.517        | 3,87                      |
| Deutsche Bundespost Zero Coupon – 90 - 31.12.19   | 19.210.000  | EUR                | 9.437.801         | 9.857.669         | 2,87                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 00 - 14.07.25   | 600.000     | EUR                | 586.547           | 583.284           | 0,17                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 98 - 04.07.28   | 1.000.000   | EUR                | 993.773           | 997.110           | 0,29                      |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 1,875% 12 - 20.12.19   | 10.000.000  | GBP                | 12.275.702        | 12.346.050        | 3,60                      |
|   |             |                    | <b>36.871.021</b> | <b>38.812.285</b> | <b>11,31</b>              |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Depfa ACS Bank 1,65% 04 - 20.12.16  | 280.000.000 | JPY                | 2.209.302         | 2.471.650         | 0,72                      |
| Ireland 2,00% 15 - 18.02.45   | 1.040.000   | EUR                | 978.432           | 1.224.522         | 0,36                      |
|   |             |                    | <b>3.187.734</b>  | <b>3.696.172</b>  | <b>1,08</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,50% 12 - 20.03.17   | 900.000     | EUR                | 955.386           | 919.917           | 0,27                      |
| Italy Buoni Ordinari del Tesoro Zero Coupon – 16 - 30.12.16                                       | 16.000.000  | EUR                | 16.000.318        | 15.992.000        | 4,66                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 07 - 01.02.17   | 4.500.000   | EUR                | 4.608.610         | 4.609.800         | 1,34                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 03 - 01.02.19   | 6.181.000   | EUR                | 6.857.286         | 6.862.349         | 2,00                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 - 01.02.18   | 1.200.000   | EUR                | 1.285.302         | 1.286.663         | 0,37                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand  
zum 30. Juni 2016

(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten                 | Marktwert                       | % des Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |               |                    |                                 |                                 |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                                 |                                 |                           |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |               |                    |                                 |                                 |                           |
| Italy Government International Bond 3,70% 96<br>- 14.11.16  | 1.097.000.000 | JPY                | 7.362.449<br><b>37.069.351</b>  | 9.744.882<br><b>39.415.611</b>  | 2,84<br><b>11,48</b>      |
| <b>Japan</b>  |               |                    |                                 |                                 |                           |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 13 -<br>20.03.18  | 350.000.000   | JPY                | 2.824.963                       | 3.091.436                       | 0,90                      |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 15 -<br>20.12.20  | 1.900.000.000 | JPY                | 15.185.590                      | 16.975.958                      | 4,95                      |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 -<br>15.12.17   | 120.000.000   | JPY                | 1.081.425<br><b>19.091.978</b>  | 1.059.068<br><b>21.126.462</b>  | 0,31<br><b>6,16</b>       |
| <b>Niederlande</b>  |               |                    |                                 |                                 |                           |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,125% 10 -<br>14.07.25  | 3.100.000     | EUR                | 3.967.474                       | 3.984.337                       | 1,16                      |
| ING Bank NV 3,625% 11 - 31.08.21  | 1.000.000     | EUR                | 1.191.030                       | 1.195.915                       | 0,35                      |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.17   | 692.000       | EUR                | 692.457                         | 693.945                         | 0,20                      |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.19   | 1.813.000     | EUR                | 1.809.193                       | 1.832.870                       | 0,53                      |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.20   | 1.911.000     | EUR                | 1.907.072<br><b>9.567.226</b>   | 1.939.168<br><b>9.646.235</b>   | 0,57<br><b>2,81</b>       |
| <b>Norwegen</b>   |               |                    |                                 |                                 |                           |
| DNB Boligkreditt AS 1,875% 12 - 18.06.19  | 1.000.000     | EUR                | 1.061.160<br><b>1.061.160</b>   | 1.061.347<br><b>1.061.347</b>   | 0,31<br><b>0,31</b>       |
| <b>Rumänien</b>   |               |                    |                                 |                                 |                           |
| Romania 6,75% 12 - 07.02.22   | 10.000.000    | USD                | 10.399.633<br><b>10.399.633</b> | 10.656.111<br><b>10.656.111</b> | 3,10<br><b>3,10</b>       |
| <b>Spanien</b>  |               |                    |                                 |                                 |                           |
| Bankia SA 4,25% 06 - 25.05.18   | 950.000       | EUR                | 1.053.550                       | 1.026.136                       | 0,30                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.17   | 1.800.000     | EUR                | 1.798.556                       | 1.801.062                       | 0,52                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.18   | 1.100.000     | EUR                | 1.096.481                       | 1.099.516                       | 0,32                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.19   | 1.600.000     | EUR                | 1.588.456                       | 1.598.352                       | 0,47                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.20   | 1.100.000     | EUR                | 1.082.251                       | 1.091.156                       | 0,32                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.21   | 1.500.000     | EUR                | 1.459.983                       | 1.476.705                       | 0,43                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.22   | 1.500.000     | EUR                | 1.437.781                       | 1.459.365                       | 0,43                      |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.23   | 2.831.000     | EUR                | 2.588.856                       | 2.655.988                       | 0,77                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.27   | 4.300.000     | EUR                | 3.493.012                       | 3.629.329                       | 1,06                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.28   | 4.100.000     | EUR                | 3.218.887                       | 3.375.448                       | 0,98                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.29   | 4.300.000     | EUR                | 3.262.833                       | 3.444.515                       | 1,00                      |
| Spain 4,90% 07 - 30.07.40   | 7.815.000     | EUR                | 10.681.542                      | 11.871.024                      | 3,46                      |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 6.833.000     | EUR                | 10.351.668<br><b>43.113.856</b> | 10.950.687<br><b>45.479.283</b> | 3,19<br><b>13,25</b>      |
| <b>Supranational</b>  |               |                    |                                 |                                 |                           |
| European Investment Bank 3,625% 12 -<br>14.03.42  | 15.000.000    | EUR                | 21.565.500<br><b>21.565.500</b> | 24.594.550<br><b>24.594.550</b> | 7,17<br><b>7,17</b>       |
| <b>Schweden</b>   |               |                    |                                 |                                 |                           |
| Stadshypotek AB 1,00% 14 - 01.04.19   | 1.400.000     | EUR                | 1.441.846<br><b>1.441.846</b>   | 1.447.950<br><b>1.447.950</b>   | 0,42<br><b>0,42</b>       |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand  
zum 30. Juni 2016

(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Schweiz</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Credit Suisse AG 4,75% 09 - 05.08.19  | 7.617.000   | EUR                | 9.008.169          | 8.641.419          | 2,52                      |
|   |             |                    | <b>9.008.169</b>   | <b>8.641.419</b>   | <b>2,52</b>               |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Network Rail Infrastructure Finance PLC<br>1,375% 07 - 22.11.37   | 1.477.359   | GBP                | 2.510.938          | 2.820.693          | 0,82                      |
| United Kingdom Gilt 3,50% 13 - 22.07.68   | 11.000.000  | GBP                | 19.804.395         | 22.907.973         | 6,67                      |
| United Kingdom Gilt 4,00% 09 - 22.01.60   | 11.649.000  | GBP                | 24.433.090         | 25.140.039         | 7,33                      |
| United Kingdom Gilt 4,50% 07 - 07.12.42   | 11.600.000  | GBP                | 21.188.552         | 22.236.068         | 6,48                      |
|   |             |                    | <b>67.936.975</b>  | <b>73.104.773</b>  | <b>21,30</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>310.988.437</b> | <b>331.032.960</b> | <b>96,46</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>310.988.437</b> | <b>331.032.960</b> | <b>96,46</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>310.988.437</b> | <b>331.032.960</b> | <b>96,46</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>334.653.232</b> | <b>97,52</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® EUROPE SHORT DAILY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien<br>AG 1,75% 13 - 02.10.20   | 200.000     | EUR                | 215.154          | 215.190          | 6,02                         |
| UniCredit Bank Austria AG 1,875% 13 -<br>29.10.20   | 500.000     | EUR                | 544.175          | 541.662          | 15,15                        |
|   |             |                    | <b>759.329</b>   | <b>756.852</b>   | <b>21,17</b>                 |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| CIF Euromortgage SA 2,00% 10 - 30.01.19   | 200.000     | CHF                | 179.851          | 196.964          | 5,51                         |
| SNCF Reseau 3,125% 13 - 25.10.28  | 300.000     | EUR                | 350.535          | 391.756          | 10,96                        |
|   |             |                    | <b>530.386</b>   | <b>588.720</b>   | <b>16,47</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Depfa ACS Bank 1,65% 04 - 20.12.16  | 20.000.000  | JPY                | 151.187          | 176.546          | 4,94                         |
|   |             |                    | <b>151.187</b>   | <b>176.546</b>   | <b>4,94</b>                  |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 15 -<br>20.03.20  | 85.000.000  | JPY                | 668.393          | 756.863          | 21,17                        |
| Japan Government Ten Year Bond 0,30% 15 -<br>20.12.24   | 85.000.000  | JPY                | 627.463          | 783.719          | 21,92                        |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,70% 13<br>- 20.12.43  | 55.000.000  | JPY                | 398.277          | 687.643          | 19,23                        |
|   |             |                    | <b>1.694.133</b> | <b>2.228.225</b> | <b>62,32</b>                 |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| European Financial Stability Facility 3,875%<br>12 - 30.03.32   | 456.000     | EUR                | 590.794          | 683.178          | 19,11                        |
|   |             |                    | <b>590.794</b>   | <b>683.178</b>   | <b>19,11</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| BMW Finance NV 5,00% 03 - 06.08.18  | 250.000     | EUR                | 291.010          | 276.520          | 7,73                         |
| Deutsche Telekom International Finance BV<br>6,00% 09 - 20.01.17  | 300.000     | EUR                | 333.720          | 309.984          | 8,67                         |
| Heineken NV 2,125% 12 - 04.08.20  | 250.000     | EUR                | 265.702          | 268.879          | 7,52                         |
|   |             |                    | <b>890.432</b>   | <b>855.383</b>   | <b>23,92</b>                 |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| CaixaBank SA 4,25% 06 - 26.01.17  | 400.000     | EUR                | 436.496          | 409.532          | 11,46                        |
| Caja Rural de Navarra 3,65% 14 - 07.02.29   | 400.000     | EUR                | 439.356          | 518.104          | 14,49                        |
| Spain 2,90% 16 - 31.10.46   | 10.000      | EUR                | 10.499           | 11.232           | 0,31                         |
|   |             |                    | <b>886.351</b>   | <b>938.868</b>   | <b>26,26</b>                 |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| SES GLOBAL Americas Holdings GP 1,875%<br>13 - 24.10.18   | 150.000     | EUR                | 156.639          | 155.836          | 4,36                         |
|   |             |                    | <b>156.639</b>   | <b>155.836</b>   | <b>4,36</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>5.659.251</b> | <b>6.383.608</b> | <b>178,55</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>5.659.251</b> | <b>6.383.608</b> | <b>178,55</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>5.659.251</b> | <b>6.383.608</b> | <b>178,55</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>6.452.658</b> | <b>180,48</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER SHORT DAILY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| CIF Euromortgage SA 2,00% 10 - 30.01.19   | 1.000.000   | CHF                | 990.039           | 984.822           | 2,11                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.26  | 550.000     | EUR                | 534.932           | 545.033           | 1,17                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.26  | 750.000     | EUR                | 713.200           | 729.720           | 1,56                         |
|   |             |                    | <b>2.238.171</b>  | <b>2.259.575</b>  | <b>4,84</b>                  |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 2,00% 11 - 04.01.22  | 500.000     | EUR                | 567.230           | 570.975           | 1,22                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,25% 11 - 04.07.21  | 1.700.000   | EUR                | 2.020.773         | 2.030.025         | 4,35                         |
| Bundesrepublik Deutschland 5,50% 00 - 04.01.31  | 400.000     | EUR                | 707.017           | 718.796           | 1,54                         |
|   |             |                    | <b>3.295.020</b>  | <b>3.319.796</b>  | <b>7,11</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Enel SpA 5,625% 07 - 21.06.27   | 440.000     | EUR                | 577.619           | 646.424           | 1,38                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,65% 15 - 01.11.20   | 1.400.000   | EUR                | 1.420.266         | 1.428.910         | 3,06                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,15% 14 - 15.05.17   | 3.700.000   | EUR                | 3.742.269         | 3.743.253         | 8,01                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 - 01.11.27   | 900.000     | EUR                | 1.365.935         | 1.367.775         | 2,93                         |
|   |             |                    | <b>7.106.089</b>  | <b>7.186.362</b>  | <b>15,38</b>                 |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 15 - 20.03.20   | 800.000.000 | JPY                | 6.244.267         | 7.123.415         | 15,25                        |
| Japan Government Ten Year Bond 0,80% 12 - 20.09.22  | 507.850.000 | JPY                | 3.764.450         | 4.769.113         | 10,21                        |
|   |             |                    | <b>10.008.717</b> | <b>11.892.528</b> | <b>25,46</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 98 - 15.01.24   | 100.000     | EUR                | 90.354            | 100.532           | 0,22                         |
| Netherlands 1,25% 12 - 15.01.18   | 1.000.000   | EUR                | 1.026.935         | 1.028.900         | 2,20                         |
| Netherlands 1,75% 13 - 15.07.23   | 2.300.000   | EUR                | 2.582.637         | 2.630.792         | 5,63                         |
| Netherlands 2,25% 12 - 15.07.22   | 400.000     | EUR                | 460.452           | 464.659           | 0,99                         |
| Netherlands 3,75% 06 - 15.01.23   | 300.000     | EUR                | 377.528           | 381.476           | 0,82                         |
|   |             |                    | <b>4.537.906</b>  | <b>4.606.359</b>  | <b>9,86</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Instituto de Credito Oficial 5,00% 05 - 31.03.20  | 4.000.000   | CAD                | 2.966.593         | 3.032.486         | 6,49                         |
| Spain 2,75% 14 - 31.10.24   | 400.000     | EUR                | 444.990           | 455.804           | 0,98                         |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 1.200.000   | EUR                | 1.300.823         | 1.305.744         | 2,79                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 4.300.000   | EUR                | 6.514.559         | 6.891.257         | 14,75                        |
|   |             |                    | <b>11.226.965</b> | <b>11.685.291</b> | <b>25,01</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER SHORT DAILY UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten               | Marktwert                     | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>                 |             |                    |                               |                               |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                               |                               |                              |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                               |                               |                              |
| European Investment Bank 4,50% 09 -<br>15.10.25   | 3.000.000   | EUR                | 4.051.410<br><b>4.051.410</b> | 4.232.755<br><b>4.232.755</b> | 9,06<br><b>9,06</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>42.464.278</b>             | <b>45.182.666</b>             | <b>96,72</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>42.464.278</b>             | <b>45.182.666</b>             | <b>96,72</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>             |             |                    |                               |                               |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                               |                               |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                               |                               |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 98 - 01.05.28  | 500.000     | EUR                | 397.413                       | 404.285                       | 0,86                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro 0.01 – 13 -<br>25.04.25   | 500.000     | EUR                | 473.832<br><b>871.245</b>     | 479.620<br><b>883.905</b>     | 1,03<br><b>1,89</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>871.245</b>                | <b>883.905</b>                | <b>1,89</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare<br/>Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>871.245</b>                | <b>883.905</b>                | <b>1,89</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>43.335.523</b>             | <b>46.066.571</b>             | <b>98,61</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                               | <b>46.573.938</b>             | <b>99,69</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Bahrain</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bahrain 5,875% 15 - 26.01.21  | 3.500.000   | USD                | 3.120.549         | 3.251.021         | 0,74                         |
| Bahrain 6,125% 12 - 05.07.22  | 2.000.000   | USD                | 1.832.053         | 1.840.426         | 0,42                         |
| Bahrain 6,125% 13 - 01.08.23  | 8.489.000   | USD                | 7.878.768         | 7.750.252         | 1,78                         |
| Bahrain 7,00% 15 - 26.01.26   | 4.000.000   | USD                | 3.694.345         | 3.655.864         | 0,84                         |
|   |             |                    | <b>16.525.715</b> | <b>16.497.563</b> | <b>3,78</b>                  |
| <b>Brasilien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Brazil 2,625% 12 - 05.01.23   | 11.999.000  | USD                | 9.438.559         | 9.836.712         | 2,26                         |
| Brazil 4,25% 13 - 07.01.25  | 10.270.000  | USD                | 8.718.960         | 9.079.334         | 2,08                         |
| Brazil 7.125% 06 - 20.01.37   | 3.500.000   | USD                | 2.946.924         | 3.548.676         | 0,81                         |
|   |             |                    | <b>21.104.443</b> | <b>22.464.722</b> | <b>5,15</b>                  |
| <b>Kolumbien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Colombia 4,00% 13 - 26.02.24  | 7.047.000   | USD                | 6.352.363         | 6.628.351         | 1,52                         |
| Colombia 7.375% 09 - 18.03.19   | 2.550.000   | USD                | 2.624.023         | 2.623.911         | 0,60                         |
|   |             |                    | <b>8.976.386</b>  | <b>9.252.262</b>  | <b>2,12</b>                  |
| <b>Kroatien</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Croatia 3,00% 15 - 11.03.25   | 1.567.000   | EUR                | 1.481.848         | 1.491.079         | 0,34                         |
| Croatia 5,50% 13 - 04.04.23   | 1.977.000   | USD                | 1.831.891         | 1.885.407         | 0,43                         |
| Croatia 6,00% 13 - 26.01.24   | 24.000.000  | USD                | 22.993.187        | 23.565.142        | 5,40                         |
| Croatia 6,375% 11 - 24.03.21  | 3.000.000   | USD                | 2.966.449         | 2.943.941         | 0,68                         |
| Croatia 6,625% 10 - 14.07.20  | 13.000.000  | USD                | 12.986.363        | 12.764.452        | 2,93                         |
| Croatia 6,75% 09 - 05.11.19   | 10.000.000  | USD                | 9.726.233         | 9.793.875         | 2,25                         |
|   |             |                    | <b>51.985.971</b> | <b>52.443.896</b> | <b>12,03</b>                 |
| <b>Ungarn</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Hungary 5,375% 14 - 25.03.24  | 18.188.000  | USD                | 18.129.434        | 18.299.173        | 4,20                         |
| Hungary 5,75% 08 - 11.06.18   | 34.600.000  | EUR                | 38.156.415        | 38.153.420        | 8,75                         |
| Hungary 5,75% 13 - 22.11.23   | 15.446.000  | USD                | 15.603.587        | 15.816.117        | 3,63                         |
| Hungary 6,375% 11 - 29.03.21  | 5.000.000   | USD                | 5.002.586         | 5.124.086         | 1,17                         |
|   |             |                    | <b>76.892.022</b> | <b>77.392.796</b> | <b>17,75</b>                 |
| <b>Indonesien</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Indonesia 4,125% 15 - 15.01.25  | 9.023.000   | USD                | 8.142.586         | 8.437.661         | 1,93                         |
| Indonesia 4,75% 15 - 08.01.26   | 5.329.000   | USD                | 4.948.192         | 5.219.156         | 1,20                         |
| Indonesia 5,875% 10 - 13.03.20  | 4.900.000   | USD                | 4.998.106         | 4.903.355         | 1,12                         |
| Indonesia 5,875% 14 - 15.01.24  | 11.650.000  | USD                | 11.856.195        | 12.110.889        | 2,78                         |
|   |             |                    | <b>29.945.079</b> | <b>30.671.061</b> | <b>7,03</b>                  |
| <b>Libanon</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Lebanon 6,00% 12 - 27.01.23   | 2.401.000   | USD                | 2.186.119         | 2.085.875         | 0,48                         |
| Lebanon 6,10% 10 - 04.10.22   | 2.359.000   | USD                | 2.164.418         | 2.063.359         | 0,47                         |
| Lebanon 6,20% 15 - 26.02.25   | 124.000     | USD                | 109.674           | 106.820           | 0,03                         |
| Lebanon 6,25% 15 - 04.11.24   | 123.000     | USD                | 109.679           | 106.562           | 0,02                         |
|   |             |                    | <b>4.569.890</b>  | <b>4.362.616</b>  | <b>1,00</b>                  |
| <b>Litauen</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Lithuania 7.375% 10 - 11.02.20  | 10.000.000  | USD                | 10.477.805        | 10.613.805        | 2,43                         |
|   |             |                    | <b>10.477.805</b> | <b>10.613.805</b> | <b>2,43</b>                  |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Commerzbank Finance & Covered Bond SA<br>FRN 07 - 20.03.17  | 8.000.000   | USD                | 5.498.285         | 7.102.970         | 1,63                         |
|   |             |                    | <b>5.498.285</b>  | <b>7.102.970</b>  | <b>1,63</b>                  |
| <b>Mexiko</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Mexico 1,625% 15 - 06.03.24   | 8.402.000   | EUR                | 8.099.846         | 8.455.913         | 1,94                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Mexiko (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Mexico 3,60% 14 - 30.01.25  | 12.078.000  | USD                | 10.926.960        | 11.387.105        | 2,61                         |
| Mexico 4,00% 13 - 02.10.23  | 4.504.000   | USD                | 4.270.236         | 4.366.362         | 1,00                         |
| Petroleos Mexicanos 2,75% 15 - 21.04.27   | 500.000     | EUR                | 454.985           | 416.250           | 0,10                         |
|   |             |                    | <b>23.752.027</b> | <b>24.625.630</b> | <b>5,65</b>                  |
| <b>Nigeria</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Nigeria 6,375% 13 - 04.01.24  | 3.800.000   | USD                | 3.239.623         | 3.288.774         | 0,75                         |
|   |             |                    | <b>3.239.623</b>  | <b>3.288.774</b>  | <b>0,75</b>                  |
| <b>Peru</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Peru 7,125% 09 - 30.03.19   | 2.000.000   | USD                | 2.101.623         | 2.075.432         | 0,48                         |
|   |             |                    | <b>2.101.623</b>  | <b>2.075.432</b>  | <b>0,48</b>                  |
| <b>Philippinen</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Philippine 4,00% 10 - 15.01.21  | 2.387.000   | USD                | 2.368.953         | 2.351.334         | 0,54                         |
| Philippine 4,20% 14 - 21.01.24  | 5.655.000   | USD                | 5.677.307         | 5.828.530         | 1,34                         |
| Philippine 5,50% 11 - 30.03.26  | 2.808.000   | USD                | 3.076.200         | 3.200.836         | 0,73                         |
|   |             |                    | <b>11.122.460</b> | <b>11.380.700</b> | <b>2,61</b>                  |
| <b>Polen</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Poland 0,875% 15 - 10.05.27   | 5.000.000   | EUR                | 4.672.993         | 4.736.050         | 1,09                         |
| Poland 1,50% 15 - 09.09.25  | 188.000     | EUR                | 192.161           | 193.796           | 0,04                         |
| Poland 1,625% 13 - 12.07.23   | 32.000.000  | EUR                | 33.214.910        | 33.198.400        | 7,61                         |
| Poland 3,75% 12 - 19.01.23  | 300.000     | EUR                | 372.750           | 357.537           | 0,08                         |
| Poland 5,25% 10 - 20.01.25  | 15.894.000  | EUR                | 21.076.237        | 21.217.536        | 4,87                         |
|   |             |                    | <b>59.529.051</b> | <b>59.703.319</b> | <b>13,69</b>                 |
| <b>Rumänien</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Romania 2,75% 15 - 29.10.25   | 1.901.000   | EUR                | 1.942.405         | 1.958.030         | 0,45                         |
| Romania 2,875% 14 - 28.10.24  | 3.411.000   | EUR                | 3.577.784         | 3.573.875         | 0,82                         |
| Romania 4,375% 13 - 22.08.23  | 2.580.000   | USD                | 2.413.667         | 2.484.670         | 0,57                         |
| Romania 4,875% 14 - 22.01.24  | 2.528.000   | USD                | 2.491.781         | 2.514.234         | 0,57                         |
| Romania 6,50% 08 - 18.06.18   | 7.000.000   | EUR                | 7.877.379         | 7.845.040         | 1,80                         |
|   |             |                    | <b>18.303.016</b> | <b>18.375.849</b> | <b>4,21</b>                  |
| <b>Russland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Russia 4,50% 12 - 04.04.22  | 9.600.000   | USD                | 8.713.932         | 9.229.209         | 2,12                         |
| Russia 4,875% 13 - 16.09.23   | 8.000.000   | USD                | 7.357.906         | 7.855.263         | 1,80                         |
|   |             |                    | <b>16.071.838</b> | <b>17.084.472</b> | <b>3,92</b>                  |
| <b>Slowenien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Slovenia 5,25% 14 - 18.02.24  | 5.095.000   | USD                | 5.077.327         | 5.173.197         | 1,19                         |
| Slovenia 5,85% 13 - 10.05.23  | 12.419.000  | USD                | 12.673.569        | 12.986.439        | 2,98                         |
|   |             |                    | <b>17.750.896</b> | <b>18.159.636</b> | <b>4,17</b>                  |
| <b>Südafrika</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| South Africa 4,665% 12 - 17.01.24   | 4.577.000   | USD                | 4.197.262         | 4.253.714         | 0,98                         |
| South Africa 5,875% 13 - 16.09.25   | 4.734.000   | USD                | 4.694.990         | 4.732.383         | 1,08                         |
|   |             |                    | <b>8.892.252</b>  | <b>8.986.097</b>  | <b>2,06</b>                  |
| <b>Türkei</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS<br>2.803% 12 - 26.03.18                                    | 5.000.000   | USD                | 4.358.228         | 4.494.894         | 1,03                         |
| Turkey 3,25% 13 - 23.03.23  | 4.496.000   | USD                | 3.838.390         | 3.922.544         | 0,90                         |
| Turkey 4,25% 15 - 14.04.26  | 5.162.000   | USD                | 4.424.530         | 4.717.056         | 1,08                         |
| Turkey 5,75% 14 - 22.03.24  | 10.420.000  | USD                | 9.931.349         | 10.422.913        | 2,39                         |
| Turkey 6,75% 07 - 03.04.18  | 7.900.000   | USD                | 7.558.818         | 7.647.918         | 1,75                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II EMERGING MARKETS LIQUID EUROBOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Türkei (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Turkey 7,00% 06 - 26.09.16  | 3.900.000   | USD                | 3.465.053          | 3.553.304          | 0,82                         |
|   |             |                    | <b>33.576.368</b>  | <b>34.758.629</b>  | <b>7,97</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>420.314.750</b> | <b>429.240.229</b> | <b>98,43</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>420.314.750</b> | <b>429.240.229</b> | <b>98,43</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>420.314.750</b> | <b>429.240.229</b> | <b>98,43</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>435.184.843</b> | <b>99,80</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II SHORT IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE DAILY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| BPCE SFH SA 1,50% 14 - 30.01.20   | 1.600.000   | EUR                | 1.693.264         | 1.698.560         | 1,01                      |
| CIF Euromortgage SA 2,00% 10 - 30.01.19   | 5.000.000   | CHF                | 5.001.080         | 4.924.110         | 2,94                      |
| CIF Euromortgage SA 3,75% 09 - 23.10.19   | 1.000.000   | EUR                | 1.143.740         | 1.129.324         | 0,68                      |
| Credit Agricole Home Loan SFH SA 4,00% 10 - 16.07.25  | 1.300.000   | EUR                | 1.658.904         | 1.730.817         | 1,03                      |
| France OAT 2,75% 12 - 25.10.27  | 3.699.000   | EUR                | 4.312.997         | 4.712.231         | 2,81                      |
| Societe Generale SFH SA 1,75% 13 - 05.03.20   | 1.000.000   | EUR                | 1.070.330         | 1.073.720         | 0,64                      |
|   |             |                    | <b>14.880.315</b> | <b>15.268.762</b> | <b>9,11</b>               |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Bundesrepublik Deutschland 5,50% 00 - 04.01.31  | 2.000.000   | EUR                | 3.238.800         | 3.593.980         | 2,15                      |
| Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale 6,25% 01 - 01.06.31                                      | 3.100.000   | EUR                | 3.688.194         | 4.746.801         | 2,83                      |
| State of Lower Saxony 4,25% 08 - 27.02.18   | 300.000     | EUR                | 335.445           | 322.719           | 0,19                      |
|   |             |                    | <b>7.262.439</b>  | <b>8.663.500</b>  | <b>5,17</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,50% 12 - 20.03.17   | 5.000.000   | EUR                | 5.260.750         | 5.110.650         | 3,05                      |
| Intesa Sanpaolo SpA 3,75% 12 - 25.09.19   | 1.000.000   | EUR                | 1.133.760         | 1.122.615         | 0,67                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 05 - 01.02.37   | 10.160.000  | EUR                | 11.354.816        | 13.481.262        | 8,04                      |
|   |             |                    | <b>17.749.326</b> | <b>19.714.527</b> | <b>11,76</b>              |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 15 - 20.03.20   | 200.000.000 | JPY                | 1.637.731         | 1.780.854         | 1,06                      |
| Japan Government Ten Year Bond 1,70% 06 - 20.09.16  | 900.000.000 | JPY                | 7.115.748         | 7.928.874         | 4,73                      |
|   |             |                    | <b>8.753.479</b>  | <b>9.709.728</b>  | <b>5,79</b>               |
| <b>Norwegen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Eika Boligkreditt AS 1,50% 14 - 12.03.21  | 1.000.000   | EUR                | 1.053.960         | 1.073.093         | 0,64                      |
|   |             |                    | <b>1.053.960</b>  | <b>1.073.093</b>  | <b>0,64</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.625% 10 - 18.01.17   | 1.000.000   | EUR                | 1.043.140         | 1.019.750         | 0,61                      |
| Bankinter SA 2,75% 13 - 26.07.16  | 1.200.000   | EUR                | 1.222.344         | 1.201.848         | 0,72                      |
| CaixaBank SA 4,25% 06 - 26.01.17  | 1.850.000   | EUR                | 1.945.312         | 1.894.085         | 1,13                      |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 10.500.000  | EUR                | 15.377.205        | 16.827.487        | 10,04                     |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 3.983.000   | EUR                | 5.492.477         | 6.046.218         | 3,61                      |
|   |             |                    | <b>25.080.478</b> | <b>26.989.388</b> | <b>16,11</b>              |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| European Investment Bank 4,50% 09 - 15.10.25  | 32.000.000  | EUR                | 43.232.640        | 45.149.389        | 26,94                     |
| European Stability Mechanism 1,375% 14 - 04.03.21   | 300.000     | EUR                | 318.672           | 324.464           | 0,19                      |
|   |             |                    | <b>43.551.312</b> | <b>45.473.853</b> | <b>27,13</b>              |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Barclays Bank PLC 2,25% 12 - 22.02.17   | 1.250.000   | EUR                | 1.288.000         | 1.268.487         | 0,76                      |
| Lloyds Bank PLC 3,50% 12 - 11.01.17   | 1.000.000   | EUR                | 1.042.440         | 1.018.340         | 0,61                      |
| United Kingdom Gilt 3,50% 13 - 22.07.68   | 1.500.000   | GBP                | 2.699.650         | 3.123.815         | 1,86                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II SHORT IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE DAILY UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| United Kingdom Gilt 4,00% 09 - 22.01.60   | 9.550.000   | GBP                | 19.361.998         | 20.610.127         | 12,30                     |
| United Kingdom Gilt 4,50% 07 - 07.12.42   | 8.769.000   | GBP                | 16.059.815         | 16.809.318         | 10,03                     |
|   |             |                    | <b>40.451.903</b>  | <b>42.830.087</b>  | <b>25,56</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>158.783.212</b> | <b>169.722.938</b> | <b>101,27</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>158.783.212</b> | <b>169.722.938</b> | <b>101,27</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>158.783.212</b> | <b>169.722.938</b> | <b>101,27</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>172.318.023</b> | <b>102,82</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Curaçao</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Portigon Finance Curacao NV FRN 01 -<br>24.01.41  | 1.900.000   | EUR                | 1.340.374        | 1.298.373        | 0,79                         |
|   |             |                    | <b>1.340.374</b> | <b>1.298.373</b> | <b>0,79</b>                  |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Aareal Bank AG 0,125% 14 - 19.09.17   | 900.000     | EUR                | 902.745          | 903.272          | 0,55                         |
| Aareal Bank AG 1,125% 14 - 21.01.19   | 1.000.000   | EUR                | 1.039.560        | 1.034.510        | 0,63                         |
| Bayerische Landesbank 1,00% 14 - 09.07.21   | 2.000.000   | EUR                | 2.078.790        | 2.117.838        | 1,29                         |
| Bayerische Landesbank 1,75% 14 - 08.04.24   | 500.000     | EUR                | 546.835          | 564.509          | 0,34                         |
| Bayerische Landesbank 2,00% 12 - 11.07.22   | 1.500.000   | EUR                | 1.639.350        | 1.690.274        | 1,03                         |
| Berlin Hyp AG 0,625% 14 - 24.06.19  | 2.500.000   | EUR                | 2.547.975        | 2.563.425        | 1,57                         |
| Berlin Hyp AG 1,125% 13 - 05.02.18  | 532.000     | EUR                | 547.981          | 543.484          | 0,33                         |
| Berlin Hyp AG 1,375% 12 - 30.05.17  | 2.532.000   | EUR                | 2.597.607        | 2.567.929        | 1,57                         |
| Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg -<br>Girozentrale FRN 00 - 28.06.30                     | 400.000     | EUR                | 326.244          | 346.748          | 0,21                         |
| Bundesobligation 0,25% 13 - 13.04.18  | 1.200.000   | EUR                | 1.216.613        | 1.219.464        | 0,75                         |
| Bundesobligation 0,50% 12 - 13.10.17  | 500.000     | EUR                | 506.759          | 507.332          | 0,31                         |
| Bundesobligation 0,50% 14 - 12.04.19  | 500.000     | EUR                | 514.834          | 516.182          | 0,32                         |
| Bundesobligation 1,00% 14 - 22.02.19  | 400.000     | EUR                | 416.734          | 417.664          | 0,26                         |
| Bundesrepublik Deutschland 5,50% 00 -<br>04.01.31   | 7.700.000   | EUR                | 13.503.492       | 13.836.824       | 8,46                         |
| Bundesrepublik Deutschland 5,625% 98 -<br>04.01.28  | 6.550.000   | EUR                | 10.452.462       | 10.938.698       | 6,69                         |
| Commerzbank AG 0,375% 14 - 30.09.19   | 750.000     | EUR                | 757.057          | 764.875          | 0,47                         |
| Commerzbank AG 1,625% 13 - 19.10.20   | 1.000.000   | EUR                | 1.076.370        | 1.080.187        | 0,66                         |
| Commerzbank AG 3,875% 10 - 22.03.17   | 6.549.000   | EUR                | 6.886.395        | 6.730.604        | 4,12                         |
| Commerzbank AG 4,375% 09 - 02.07.19   | 3.789.000   | EUR                | 4.434.939        | 4.312.336        | 2,64                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.17  | 800.000     | EUR                | 804.021          | 804.864          | 0,49                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.01.22  | 400.000     | EUR                | 403.919          | 407.884          | 0,25                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.22  | 300.000     | EUR                | 304.397          | 307.311          | 0,19                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 00 -<br>20.06.26  | 300.000     | EUR                | 287.818          | 297.720          | 0,18                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 94 -<br>04.01.29  | 300.000     | EUR                | 300.756          | 305.340          | 0,19                         |
| Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank<br>AG 0,875% 14 - 21.07.21                                | 500.000     | EUR                | 516.825          | 526.465          | 0,32                         |
| Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank<br>AG 1,375% 13 - 29.01.20                                | 800.000     | EUR                | 839.512          | 847.411          | 0,52                         |
| Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank<br>AG 3,65% 05 - 28.12.20                                 | 10.000.000  | EUR                | 11.556.500       | 11.670.600       | 7,14                         |
| Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank<br>AG 3,70% 05 - 16.12.20                                 | 10.000.000  | EUR                | 11.555.500       | 11.667.100       | 7,13                         |
| Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank<br>AG 4,00% 06 - 31.10.16                                 | 4.150.000   | EUR                | 4.360.102        | 4.206.647        | 2,57                         |
| Deutsche Hypothekenbank AG 0,875% 13 -<br>24.01.18  | 900.000     | EUR                | 910.593          | 915.062          | 0,56                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|----------------|-----------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                |           |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                |           |                              |
| <b>Deutschland (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                |           |                              |
| Deutsche Hypothekbank AG 1,375% 13 - 10.06.20   | 1.500.000   | EUR                | 1.591.260      | 1.595.880 | 0,98                         |
| Deutsche Hypothekbank AG 2,50% 06 - 08.03.18  | 3.700.000   | CHF                | 3.646.546      | 3.583.878 | 2,19                         |
| Deutsche Kreditbank AG 1,375% 14 - 25.02.21   | 1.300.000   | EUR                | 1.378.858      | 1.394.373 | 0,85                         |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 0,25% 14 - 08.09.17  | 1.400.000   | EUR                | 1.407.168      | 1.407.255 | 0,86                         |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 1,375% 13 - 28.08.18   | 2.450.000   | EUR                | 2.549.693      | 2.533.655 | 1,55                         |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 1,50% 13 - 18.03.20  | 400.000     | EUR                | 419.284        | 425.610   | 0,26                         |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 1,875% 14 - 21.01.22   | 1.500.000   | EUR                | 1.642.530      | 1.658.910 | 1,01                         |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 2,00% 13 - 19.07.16  | 89.000      | EUR                | 89.886         | 89.064    | 0,05                         |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 2,375% 13 - 29.05.28   | 1.200.000   | EUR                | 1.302.896      | 1.435.766 | 0,88                         |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 3,375% 10 - 18.01.17   | 532.000     | EUR                | 571.363        | 542.108   | 0,33                         |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 4,00% 09 - 22.10.19  | 532.000     | EUR                | 624.366        | 605.882   | 0,37                         |
| Dexia Kommunalbank Deutschland AG 4,75% 08 - 23.05.18   | 1.540.000   | EUR                | 1.779.988      | 1.682.257 | 1,03                         |
| Hamburgische Landesbank Girozentrale FRN 00 - 11.12.20  | 8.000.000   | EUR                | 7.163.760      | 7.708.240 | 4,71                         |
| HSH Nordbank AG 0,75% 14 - 07.10.21   | 750.000     | EUR                | 763.657        | 778.116   | 0,48                         |
| HSH Nordbank AG 1,375% 13 - 02.10.18  | 800.000     | EUR                | 832.528        | 827.099   | 0,51                         |
| HSH Nordbank AG 1,875% 12 - 05.04.17  | 400.000     | EUR                | 416.320        | 405.824   | 0,25                         |
| ING-DiBa AG 2,00% 12 - 13.03.19   | 1.000.000   | EUR                | 1.076.180      | 1.060.613 | 0,65                         |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 1,375% 12 - 01.06.18  | 3.900.000   | EUR                | 4.050.882      | 4.019.749 | 2,46                         |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 6,00% 00 - 15.06.20   | 4.900.000   | EUR                | 5.896.934      | 5.839.134 | 3,57                         |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 7,625% 93 - 01.02.23  | 5.900.000   | USD                | 6.607.379      | 6.806.021 | 4,16                         |
| Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 0,875% 12 - 06.11.17                                    | 3.000.000   | EUR                | 3.068.820      | 3.044.250 | 1,86                         |
| Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 1,00% 13 - 26.06.18                                     | 800.000     | EUR                | 822.968        | 819.447   | 0,50                         |
| Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 2,00% 12 - 26.04.19                                     | 1.500.000   | EUR                | 1.618.305      | 1.596.450 | 0,98                         |
| Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 6,25% 01 - 01.06.31                                     | 3.400.000   | EUR                | 5.016.192      | 5.206.168 | 3,18                         |
| Muenchener Hypothekbank eG 1,125% 13 - 04.10.18   | 1.750.000   | EUR                | 1.796.565      | 1.804.695 | 1,10                         |
| Muenchener Hypothekbank eG 1,50% 14 - 25.06.24  | 600.000     | EUR                | 624.606        | 666.444   | 0,41                         |
| Muenchener Hypothekbank eG 1,75% 12 - 03.06.22  | 1.000.000   | EUR                | 1.091.380      | 1.110.204 | 0,68                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Deutschland (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Norddeutsche Landesbank Girozentrale<br>1,125% 14 - 19.02.19  | 750.000     | EUR                | 774.765            | 772.616            | 0,47                         |
| Norddeutsche Landesbank Girozentrale 1,50%<br>12 - 05.12.19   | 1.400.000   | EUR                | 1.487.152          | 1.484.161          | 0,91                         |
| Norddeutsche Landesbank Girozentrale<br>1,625% 12 - 17.07.17  | 600.000     | EUR                | 615.978            | 610.226            | 0,37                         |
| Norddeutsche Landesbank Girozentrale 3,25%<br>11 - 18.01.21   | 532.000     | EUR                | 618.189            | 615.944            | 0,38                         |
| NRW Bank 3,875% 05 - 27.01.20   | 1.000.000   | EUR                | 1.157.650          | 1.150.197          | 0,70                         |
| State of Berlin 1,875% 13 - 10.09.21  | 300.000     | EUR                | 321.243            | 332.250            | 0,20                         |
| UniCredit Bank AG 1,25% 13 - 22.04.20   | 1.900.000   | EUR                | 1.992.384          | 2.008.008          | 1,23                         |
| UniCredit Bank AG 1,875% 12 - 12.09.22  | 400.000     | EUR                | 428.456            | 448.462            | 0,27                         |
|   |             |                    | <b>149.078.816</b> | <b>150.681.515</b> | <b>92,13</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| German Postal Pensions Securitisation 2 PLC<br>4,375% 06 - 18.01.22                                       | 4.400.000   | EUR                | 5.578.188          | 5.474.362          | 3,35                         |
|   |             |                    | <b>5.578.188</b>   | <b>5.474.362</b>   | <b>3,35</b>                  |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Commerzbank Finance & Covered Bond SA<br>FRN 07 - 20.03.17  | 3.500.000   | USD                | 3.151.906          | 3.107.549          | 1,90                         |
|   |             |                    | <b>3.151.906</b>   | <b>3.107.549</b>   | <b>1,90</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>159.149.284</b> | <b>160.561.799</b> | <b>98,17</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>159.149.284</b> | <b>160.561.799</b> | <b>98,17</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>159.149.284</b> | <b>160.561.799</b> | <b>98,17</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>162.304.710</b> | <b>99,24</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX £ GILTS UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in GBP)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten   | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| United Kingdom Gilt 3,25% 12 - 22.01.44   | 977.000     | GBP                | 1.165.638        | 1.298.171        | 25,56                     |
| United Kingdom Gilt 3,50% 13 - 22.07.68   | 400.000     | GBP                | 497.919          | 692.280          | 13,63                     |
| United Kingdom Gilt 3,75% 11 - 07.09.21   | 400.000     | GBP                | 472.060          | 468.669          | 9,23                      |
| United Kingdom Gilt 3,75% 11 - 22.07.52   | 283.000     | GBP                | 353.246          | 449.570          | 8,85                      |
| United Kingdom Gilt 4,00% 09 - 22.01.60   | 400.000     | GBP                | 573.156          | 717.406          | 14,12                     |
| United Kingdom Gilt 4,25% 03 - 07.03.36   | 400.000     | GBP                | 498.988          | 577.048          | 11,36                     |
| United Kingdom Gilt 4,25% 09 - 07.09.39   | 400.000     | GBP                | 503.574          | 594.768          | 11,71                     |
| United Kingdom Gilt 4,25% 10 - 07.12.40   | 400.000     | GBP                | 411.412          | 603.323          | 11,88                     |
| United Kingdom Gilt 4,25% 06 - 07.12.46   | 400.000     | GBP                | 483.416          | 639.793          | 12,60                     |
|   |             |                    | <b>4.959.409</b> | <b>6.041.028</b> | <b>118,94</b>             |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>4.959.409</b> | <b>6.041.028</b> | <b>118,94</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>4.959.409</b> | <b>6.041.028</b> | <b>118,94</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>4.959.409</b> | <b>6.041.028</b> | <b>118,94</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>6.090.711</b> | <b>119,92</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX UK GILT INFLATION-LINKED UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in GBP)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| United Kingdom Gilt 3,25% 12 - 22.01.44   | 1.200.000   | GBP                | 1.442.118         | 1.594.478         | 25,73                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125%<br>12 - 22.03.44  | 1.001.685   | GBP                | 1.330.340         | 1.489.355         | 24,03                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125%<br>16 - 22.11.65  | 802.936     | GBP                | 1.413.182         | 1.722.539         | 27,79                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125%<br>13 - 22.03.68  | 732.774     | GBP                | 1.338.183         | 1.648.082         | 26,59                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,25%<br>12 - 22.03.52   | 755.930     | GBP                | 1.094.326         | 1.317.397         | 21,26                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,50%<br>09 - 22.03.50   | 854.966     | GBP                | 1.330.145         | 1.530.774         | 24,70                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,75%<br>07 - 22.11.47   | 391.266     | GBP                | 606.497           | 711.459           | 11,48                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 1,25%<br>08 - 22.11.32   | 1.000.383   | GBP                | 1.389.049         | 1.495.022         | 24,12                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 1,875%<br>07 - 22.11.22  | 561.778     | GBP                | 686.451           | 706.997           | 11,41                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 2,00%<br>02 - 26.01.35   | 275.100     | GBP                | 652.771           | 696.952           | 11,25                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 2,50%<br>83 - 26.07.16   | 217.107     | GBP                | 585.427           | 692.017           | 11,17                        |
| United Kingdom Gilt Inflation Linked 2,50%<br>86 - 17.07.24   | 201.294     | GBP                | 579.535           | 719.484           | 11,61                        |
|   |             |                    | <b>12.448.024</b> | <b>14.324.556</b> | <b>231,14</b>                |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>12.448.024</b> | <b>14.324.556</b> | <b>231,14</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>12.448.024</b> | <b>14.324.556</b> | <b>231,14</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>12.448.024</b> | <b>14.324.556</b> | <b>231,14</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>14.364.442</b> | <b>231,79</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE RATE UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Belgium 5,50% 98 - 28.03.28   | 800.000     | EUR                | 1.404.681         | 1.423.103         | 0,22                         |
|   |             |                    | <b>1.404.681</b>  | <b>1.423.103</b>  | <b>0,22</b>                  |
| <b>Dänemark</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Carlsberg Breweries A/S 3,375% 10 - 13.10.17  | 1.500.000   | EUR                | 1.785.951         | 1.736.593         | 0,27                         |
|   |             |                    | <b>1.785.951</b>  | <b>1.736.593</b>  | <b>0,27</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Caisse Francaise de Financement Local 2,50%<br>09 - 02.05.18                                      | 10.000.000  | CHF                | 11.744.171        | 10.866.147        | 1,66                         |
| Cie de Financement Foncier SA 2,00% 10 -<br>20.12.17  | 10.000.000  | CHF                | 11.484.259        | 10.652.638        | 1,63                         |
| Cie de Financement Foncier SA 2,25% 10 -<br>13.10.21  | 5.000.000   | CHF                | 6.143.441         | 5.917.163         | 0,90                         |
| France OAT 1,75% 14 - 25.11.24  | 5.800.000   | EUR                | 7.433.548         | 7.387.525         | 1,13                         |
| France OAT 1,75% 16 - 25.05.66  | 22.000.000  | EUR                | 23.943.262        | 28.048.117        | 4,28                         |
| France OAT 2,75% 12 - 25.10.27  | 2.300.000   | EUR                | 3.223.195         | 3.255.100         | 0,50                         |
| France OAT 3,25% 13 - 25.05.45  | 3.920.000   | EUR                | 5.796.273         | 6.920.503         | 1,06                         |
| France OAT 4,75% 04 - 25.04.35  | 5.800.000   | EUR                | 10.822.023        | 11.164.116        | 1,70                         |
|   |             |                    | <b>80.590.172</b> | <b>84.211.309</b> | <b>12,86</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesobligation 1,00% 13 - 12.10.18  | 1.400.000   | EUR                | 1.655.755         | 1.614.443         | 0,25                         |
| Bundesrepublik Deutschland 0,50% 16 -<br>15.02.26   | 1.300.000   | EUR                | 1.535.429         | 1.532.787         | 0,24                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 06 -<br>04.07.16   | 2.150.000   | EUR                | 2.398.945         | 2.388.302         | 0,37                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 07 -<br>04.01.18   | 1.768.000   | EUR                | 2.075.658         | 2.103.380         | 0,32                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,75% 98 -<br>04.07.28   | 1.000.000   | EUR                | 1.751.141         | 1.765.585         | 0,27                         |
| Daimler AG 2,375% 13 - 08.03.23   | 1.000.000   | EUR                | 1.160.421         | 1.260.472         | 0,19                         |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked<br>Bond 0,50% 14 - 15.04.30                              | 3.230.784   | EUR                | 3.966.572         | 4.331.851         | 0,66                         |
| Deutsche Hypothekenbank AG 2,50% 06 -<br>08.03.18   | 3.300.000   | CHF                | 3.552.648         | 3.551.074         | 0,54                         |
| KfW 4,125% 07 - 04.07.17  | 1.000.000   | EUR                | 1.232.734         | 1.161.515         | 0,18                         |
| KfW 4,625% 07 - 04.01.23  | 5.000.000   | EUR                | 7.637.391         | 7.349.004         | 1,12                         |
| KfW 5,75% 01 - 07.06.32   | 16.200.000  | GBP                | 35.752.696        | 33.917.735        | 5,18                         |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg FRN 00 -<br>04.10.30  | 5.200.000   | EUR                | 4.932.955         | 4.998.379         | 0,76                         |
|   |             |                    | <b>67.652.345</b> | <b>65.974.527</b> | <b>10,08</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| LBB Finance Ireland PLC FRN 00 - 21.07.20   | 1.350.000   | EUR                | 1.707.848         | 1.444.740         | 0,22                         |
|   |             |                    | <b>1.707.848</b>  | <b>1.444.740</b>  | <b>0,22</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,50%<br>12 - 20.03.17  | 45.500.000  | EUR                | 53.645.748        | 51.666.829        | 7,89                         |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro Zero Coupon –<br>16 - 30.06.16                                    | 1.044.000   | EUR                | 1.130.440         | 1.159.831         | 0,18                         |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro Zero Coupon –<br>15 - 14.07.16                                    | 1.117.000   | EUR                | 1.209.490         | 1.241.005         | 0,19                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE RATE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |               |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Ordinari del Tesoro Zero Coupon –<br>16 - 30.12.16                                    | 36.600.000    | EUR                | 40.683.523         | 40.640.418         | 6,21                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,65% 15 -<br>01.11.20  | 12.800.000    | EUR                | 14.729.168         | 14.513.798         | 2,22                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,15% 14 -<br>15.12.21  | 5.088.000     | EUR                | 6.081.084          | 6.168.372          | 0,94                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 04 -<br>15.09.35  | 3.835.379     | EUR                | 5.887.777          | 5.419.667          | 0,83                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 05 -<br>01.02.37  | 3.500.000     | EUR                | 5.160.326          | 5.159.400          | 0,79                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 -<br>01.08.18  | 3.067.000     | EUR                | 3.682.730          | 3.729.211          | 0,57                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 13 -<br>01.09.28  | 1.200.000     | EUR                | 1.805.377          | 1.804.786          | 0,27                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 09 -<br>01.09.40  | 6.644.000     | EUR                | 10.556.740         | 11.207.535         | 1,71                         |
|   |               |                    | <b>144.572.403</b> | <b>142.710.852</b> | <b>21,80</b>                 |
| <b>Japan</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| Japan Government Five Year Bond 0,20% 12 -<br>20.06.17  | 1.975.000.000 | JPY                | 16.612.841         | 19.343.796         | 2,95                         |
| Japan Government Ten Year Bond 0,10% 16 -<br>21.01.23   | 815.000.000   | JPY                | 7.957.822          | 8.210.932          | 1,25                         |
| Japan Government Ten Year Bond 0,80% 13 -<br>20.06.23   | 422.000.000   | JPY                | 3.648.650          | 4.438.507          | 0,68                         |
| Japan Government Ten Year Bond 1,00% 10 -<br>20.09.20   | 602.600.000   | JPY                | 5.219.221          | 6.199.220          | 0,95                         |
| Japan Government Ten Year Bond 1,00% 12 -<br>20.03.22   | 800.000.000   | JPY                | 6.999.196          | 8.393.411          | 1,28                         |
| Japan Government Ten Year Bond 1,30% 11 -<br>20.03.21   | 600.000.000   | JPY                | 5.298.016          | 6.293.245          | 0,96                         |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,40% 15<br>- 20.09.45  | 600.000.000   | JPY                | 5.066.064          | 7.987.387          | 1,22                         |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,50% 15<br>- 20.03.45  | 332.000.000   | JPY                | 2.798.378          | 4.496.773          | 0,69                         |
| Japan Government Thirty Year Bond 2,20% 11<br>- 20.03.41  | 850.000.000   | JPY                | 11.187.087         | 12.471.527         | 1,91                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 1,30%<br>15 - 20.06.35  | 500.000.000   | JPY                | 4.238.369          | 6.031.777          | 0,92                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 1,90%<br>11 - 20.03.31  | 300.000.000   | JPY                | 2.872.240          | 3.793.294          | 0,58                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,00%<br>11 - 20.12.30  | 500.000.000   | JPY                | 4.939.513          | 6.370.796          | 0,97                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,20%<br>08 - 20.09.28  | 275.000.000   | JPY                | 2.727.717          | 3.462.845          | 0,53                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,40%<br>08 - 20.03.28  | 450.000.000   | JPY                | 5.342.056          | 5.728.760          | 0,88                         |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 -<br>15.02.17   | 375.000.000   | JPY                | 3.111.262          | 3.663.917          | 0,56                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE RATE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |               |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                    |                    |                              |
| <b>Japan (Fortsetzung)</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 - 15.04.17  | 649.000.000   | JPY                | 5.385.310          | 6.346.713          | 0,97                         |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 - 15.07.17  | 3.150.000.000 | JPY                | 28.863.849         | 30.839.848         | 4,71                         |
|   |               |                    | <b>122.267.591</b> | <b>144.072.748</b> | <b>22,01</b>                 |
| <b>Luxemburg</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| European Financial Stability Facility 3.875% 12 - 30.03.32  | 4.555.000     | EUR                | 7.705.309          | 7.581.442          | 1,16                         |
|   |               |                    | <b>7.705.309</b>   | <b>7.581.442</b>   | <b>1,16</b>                  |
| <b>Niederlande</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| Enel Finance International NV 1,966% 15 - 27.01.25  | 1.570.000     | EUR                | 1.731.017          | 1.903.836          | 0,29                         |
| Netherlands 0,50% 14 - 15.04.17   | 6.861.000     | EUR                | 7.605.861          | 7.687.775          | 1,18                         |
| Netherlands 4,50% 07 - 15.07.17   | 2.205.000     | EUR                | 2.551.742          | 2.578.993          | 0,39                         |
|   |               |                    | <b>11.888.620</b>  | <b>12.170.604</b>  | <b>1,86</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 1.100.000     | EUR                | 1.365.276          | 1.329.731          | 0,20                         |
| Spain 4,90% 07 - 30.07.40   | 14.000.000    | EUR                | 20.913.590         | 23.625.528         | 3,61                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 14.500.000    | EUR                | 22.810.718         | 25.816.196         | 3,95                         |
|   |               |                    | <b>45.089.584</b>  | <b>50.771.455</b>  | <b>7,76</b>                  |
| <b>Supranational</b>  |               |                    |                    |                    |                              |
| European Investment Bank 1,40% 05 - 20.06.17  | 300.000.000   | JPY                | 2.479.090          | 2.969.646          | 0,45                         |
| European Investment Bank 3,50% 12 - 15.04.27  | 5.400.000     | EUR                | 7.896.014          | 8.077.042          | 1,24                         |
| European Investment Bank 3,625% 12 - 14.03.42   | 12.000.000    | EUR                | 19.035.090         | 21.858.641         | 3,34                         |
| European Investment Bank 4,50% 09 - 15.10.25  | 3.600.000     | EUR                | 5.332.137          | 5.642.852          | 0,86                         |
|   |               |                    | <b>34.742.331</b>  | <b>38.548.181</b>  | <b>5,89</b>                  |
| <b>Schweden</b>   |               |                    |                    |                    |                              |
| Landshypotek Bank AB 1,50% 11 - 24.10.18  | 9.800.000     | CHF                | 11.121.668         | 10.564.424         | 1,61                         |
|   |               |                    | <b>11.121.668</b>  | <b>10.564.424</b>  | <b>1,61</b>                  |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |               |                    |                    |                    |                              |
| Royal Bank of Scotland PLC 5.375% 09 - 30.09.19   | 7.370.000     | EUR                | 9.393.233          | 9.350.704          | 1,43                         |
| United Kingdom Gilt 4,00% 09 - 22.01.60   | 5.850.000     | GBP                | 13.560.497         | 14.025.794         | 2,14                         |
|   |               |                    | <b>22.953.730</b>  | <b>23.376.498</b>  | <b>3,57</b>                  |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |               |                    |                    |                    |                              |
| Apple Inc. 3,05% 15 - 31.07.29  | 2.600.000     | GBP                | 3.889.591          | 3.694.315          | 0,57                         |
| Citigroup Inc. 2,375% 14 - 22.05.24   | 1.250.000     | EUR                | 1.396.550          | 1.514.382          | 0,23                         |
| Goldman Sachs Group Inc. 2,00% 15 - 27.07.23  | 1.250.000     | EUR                | 1.364.320          | 1.461.508          | 0,22                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE RATE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten                 | Marktwert                       | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|---------------------------------|---------------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>                 |             |                    |                                 |                                 |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                                 |                                 |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                                 |                                 |                              |
| United States Treasury Notes 4,50% 06 -<br>15.02.36   | 27.100.000  | USD                | 38.526.921<br><b>45.177.382</b> | 39.104.453<br><b>45.774.658</b> | 5,97<br><b>6,99</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>598.659.615</b>              | <b>630.361.134</b>              | <b>96,30</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>598.659.615</b>              | <b>630.361.134</b>              | <b>96,30</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>             |             |                    |                                 |                                 |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                                 |                                 |                              |
| <b>Kanada</b>   |             |                    |                                 |                                 |                              |
| Canada 2,00% 07 - 01.12.41  | 3.014.692   | CAD                | 3.798.262                       | 3.276.908                       | 0,50                         |
| Canada 5,75% 98 - 01.06.29  | 6.950.000   | CAD                | 7.849.034<br><b>11.647.296</b>  | 8.109.724<br><b>11.386.632</b>  | 1,24<br><b>1,74</b>          |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                                 |                                 |                              |
| Italy Government International Bond FRN 08 -<br>24.04.18  | 800.000.000 | JPY                | 6.504.069<br><b>6.504.069</b>   | 7.692.368<br><b>7.692.368</b>   | 1,17<br><b>1,17</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>18.151.365</b>               | <b>19.079.000</b>               | <b>2,91</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare<br/>Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>18.151.365</b>               | <b>19.079.000</b>               | <b>2,91</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>616.810.980</b>              | <b>649.440.134</b>              | <b>99,21</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                                 | <b>654.435.315</b>              | <b>99,97</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II STERLING CASH UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in GBP)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Cie de Financement Foncier SA 2,375% 05 -<br>24.08.18   | 4.000.000   | CHF                | 3.030.247         | 3.273.105         | 5,50                      |
| France OAT 2,25% 13 - 25.05.24  | 1.400.000   | EUR                | 1.290.026         | 1.378.598         | 2,32                      |
| France OAT 3,25% 11 - 25.10.21  | 900.000     | EUR                | 841.572           | 891.655           | 1,50                      |
| Orange SA 3,875% 10 - 14.01.21  | 1.250.000   | EUR                | 1.011.827         | 1.213.857         | 2,04                      |
|   |             |                    | <b>6.173.672</b>  | <b>6.757.215</b>  | <b>11,36</b>              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Bundesobligation 0,50% 12 - 13.10.17  | 2.600.000   | EUR                | 2.072.505         | 2.192.419         | 3,69                      |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 7,625% 93 -<br>01.02.23   | 8.200.000   | USD                | 7.054.170         | 7.861.093         | 13,21                     |
|   |             |                    | <b>9.126.675</b>  | <b>10.053.512</b> | <b>16,90</b>              |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Ireland 2,00% 15 - 18.02.45   | 7.000.000   | EUR                | 4.334.782         | 6.849.507         | 11,51                     |
|   |             |                    | <b>4.334.782</b>  | <b>6.849.507</b>  | <b>11,51</b>              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 07 -<br>01.08.39  | 4.300.000   | EUR                | 4.825.516         | 5.425.860         | 9,12                      |
|   |             |                    | <b>4.825.516</b>  | <b>5.425.860</b>  | <b>9,12</b>               |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,00%<br>11 - 20.12.30  | 300.000.000 | JPY                | 1.944.423         | 2.859.424         | 4,80                      |
|   |             |                    | <b>1.944.423</b>  | <b>2.859.424</b>  | <b>4,80</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Spain 1,60% 15 - 30.04.25   | 1.700.000   | EUR                | 1.353.784         | 1.487.919         | 2,50                      |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 10.000.000  | EUR                | 10.376.687        | 13.318.575        | 22,39                     |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 3.100.000   | EUR                | 3.574.321         | 3.910.777         | 6,57                      |
|   |             |                    | <b>15.304.792</b> | <b>18.717.271</b> | <b>31,46</b>              |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| European Investment Bank 0,50% 14 -<br>15.09.17   | 600.000     | EUR                | 478.817           | 504.001           | 0,84                      |
| European Investment Bank 1,50% 13 -<br>15.07.20   | 750.000     | EUR                | 621.552           | 671.112           | 1,13                      |
| European Investment Bank 3,625% 12 -<br>14.03.42  | 9.000.000   | EUR                | 9.572.566         | 12.263.599        | 20,61                     |
|   |             |                    | <b>10.672.935</b> | <b>13.438.712</b> | <b>22,58</b>              |
| <b>Schweden</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Sweden Inflation Linked Bond 3,50% 99 -<br>01.12.28   | 13.770.000  | SEK                | 2.076.295         | 2.415.618         | 4,06                      |
|   |             |                    | <b>2.076.295</b>  | <b>2.415.618</b>  | <b>4,06</b>               |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| United Kingdom Gilt 3,50% 13 - 22.07.68   | 7.350.000   | GBP                | 10.855.248        | 12.720.645        | 21,38                     |
|   |             |                    | <b>10.855.248</b> | <b>12.720.645</b> | <b>21,38</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>65.314.338</b> | <b>79.237.764</b> | <b>133,17</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>65.314.338</b> | <b>79.237.764</b> | <b>133,17</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>65.314.338</b> | <b>79.237.764</b> | <b>133,17</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>80.242.374</b> | <b>134,86</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Austria 3,40% 12 - 22.11.22   | 16.693.000  | EUR                | 20.317.616        | 20.665.796        | 2,71                         |
| Austria 3,65% 11 - 20.04.22   | 4.823.000   | EUR                | 5.888.738         | 5.943.370         | 0,78                         |
| Austria 4,15% 07 - 15.03.37   | 3.911.000   | EUR                | 5.840.138         | 6.590.714         | 0,86                         |
| Austria 4,35% 08 - 15.03.19   | 1.260.000   | EUR                | 1.442.952         | 1.425.997         | 0,19                         |
|   |             |                    | <b>33.489.444</b> | <b>34.625.877</b> | <b>4,54</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Belgium 4,00% 12 - 28.03.32   | 12.966.000  | EUR                | 18.378.626        | 19.771.078        | 2,59                         |
| Belgium 4,25% 12 - 28.09.22   | 4.906.000   | EUR                | 6.201.263         | 6.317.235         | 0,83                         |
| Belgium 5,00% 04 - 28.03.35   | 1.797.000   | EUR                | 2.821.092         | 3.181.508         | 0,42                         |
| Belgium 5,50% 98 - 28.03.28   | 3.155.000   | EUR                | 4.737.864         | 5.051.860         | 0,66                         |
|   |             |                    | <b>32.138.845</b> | <b>34.321.681</b> | <b>4,50</b>                  |
| <b>Kanada</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Canada 3,50% 11 - 01.12.45  | 3.000.000   | CAD                | 2.747.984         | 2.933.899         | 0,39                         |
|   |             |                    | <b>2.747.984</b>  | <b>2.933.899</b>  | <b>0,39</b>                  |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Finland 0,875% 15 - 15.09.25  | 1.651.000   | EUR                | 1.648.559         | 1.768.881         | 0,23                         |
|   |             |                    | <b>1.648.559</b>  | <b>1.768.881</b>  | <b>0,23</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.10.16  | 1.782.000   | EUR                | 1.784.624         | 1.785.154         | 0,23                         |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.02.18  | 12.330.000  | EUR                | 12.412.737        | 12.442.737        | 1,63                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.18  | 544.000     | EUR                | 544.886           | 549.320           | 0,07                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.19  | 1.992.000   | EUR                | 1.991.894         | 2.020.645         | 0,27                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.20  | 2.072.000   | EUR                | 2.058.448         | 2.106.250         | 0,28                         |
| France OAT Zero Coupon – 09 - 25.04.30  | 1.477.000   | EUR                | 1.181.100         | 1.373.595         | 0,18                         |
| France OAT 1,50% 15 - 25.05.31  | 2.068.000   | EUR                | 2.085.868         | 2.362.072         | 0,31                         |
| France OAT 2,50% 10 - 25.10.20  | 732.000     | EUR                | 818.266           | 824.830           | 0,11                         |
| France OAT 3,25% 11 - 25.10.21  | 5.600.000   | EUR                | 6.615.109         | 6.675.975         | 0,88                         |
| France OAT 3,75% 05 - 25.04.21  | 2.676.000   | EUR                | 3.195.224         | 3.212.602         | 0,42                         |
| France OAT 4,00% 10 - 25.04.60  | 2.000.000   | EUR                | 3.430.385         | 3.946.690         | 0,52                         |
| France OAT 5,00% 01 - 25.10.16  | 4.494.000   | EUR                | 4.571.565         | 4.571.072         | 0,60                         |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 19.643.000  | EUR                | 27.931.359        | 32.410.885        | 4,25                         |
| France OAT 5,75% 01 - 25.10.32  | 11.318.000  | EUR                | 18.685.345        | 20.638.241        | 2,71                         |
|   |             |                    | <b>87.306.810</b> | <b>94.920.068</b> | <b>12,46</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesobligation 0,25% 13 - 13.04.18  | 4.000.000   | EUR                | 4.054.997         | 4.064.880         | 0,53                         |
| Bundesobligation 0,50% 12 - 07.04.17  | 1.734.000   | EUR                | 1.747.303         | 1.749.086         | 0,23                         |
| Bundesobligation 0,50% 13 - 23.02.18  | 1.184.000   | EUR                | 1.203.227         | 1.206.576         | 0,16                         |
| Bundesobligation 0,75% 12 - 24.02.17  | 1.775.000   | EUR                | 1.794.765         | 1.791.152         | 0,23                         |
| Bundesobligation 1,00% 13 - 12.10.18  | 4.400.000   | EUR                | 4.554.861         | 4.567.233         | 0,60                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,00% 15 - 15.08.25  | 668.000     | EUR                | 718.646           | 741.851           | 0,10                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 12 - 04.09.22  | 443.000     | EUR                | 490.004           | 498.245           | 0,07                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 13 - 15.05.23  | 8.967.000   | EUR                | 9.975.070         | 10.182.860        | 1,34                         |
| Bundesrepublik Deutschland 2,00% 13 - 15.08.23  | 7.825.000   | EUR                | 9.006.670         | 9.201.946         | 1,21                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,25% 11 - 04.07.21  | 5.531.000   | EUR                | 6.521.684         | 6.604.745         | 0,87                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |               |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                   |                   |                              |
| <b>Deutschland (Fortsetzung)</b>  |               |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 3,75% 06 -<br>04.01.17   | 595.000       | EUR                | 620.561           | 608.316           | 0,08                         |
| Bundesrepublik Deutschland 6,25% 94 -<br>04.01.24   | 4.855.000     | EUR                | 7.246.508         | 7.319.317         | 0,96                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.19  | 4.083.000     | EUR                | 4.073.635         | 4.152.248         | 0,54                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.01.21  | 1.497.000     | EUR                | 1.483.555         | 1.526.700         | 0,20                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 00 -<br>04.01.30  | 1.871.000     | EUR                | 1.599.865         | 1.851.841         | 0,24                         |
|   |               |                    | <b>55.091.351</b> | <b>56.066.996</b> | <b>7,36</b>                  |
| <b>Irland</b>   |               |                    |                   |                   |                              |
| Irland 2,00% 15 - 18.02.45  | 15.811.000    | EUR                | 14.046.225        | 18.616.276        | 2,44                         |
| Irland 5,90% 09 - 18.10.19  | 21.200.000    | EUR                | 25.963.490        | 25.496.418        | 3,35                         |
|   |               |                    | <b>40.009.715</b> | <b>44.112.694</b> | <b>5,79</b>                  |
| <b>Italien</b>  |               |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Ordinari del Tesoro Zero Coupon –<br>16 - 30.12.16                                    | 23.800.000    | EUR                | 23.800.474        | 23.788.100        | 3,12                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,15% 14 -<br>15.05.17  | 3.000.000     | EUR                | 3.031.377         | 3.035.070         | 0,40                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,65% 15 -<br>01.03.32  | 2.480.000     | EUR                | 2.361.034         | 2.460.938         | 0,32                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,75% 13 -<br>15.11.16  | 5.320.000     | EUR                | 5.376.176         | 5.378.254         | 0,71                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 10 -<br>01.03.21  | 24.600.000    | EUR                | 28.462.424        | 28.538.239        | 3,74                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 13 -<br>01.05.23  | 1.380.000     | EUR                | 1.699.703         | 1.723.793         | 0,23                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 11 -<br>01.03.22  | 6.708.000     | EUR                | 8.438.999         | 8.382.518         | 1,10                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 07 -<br>01.08.39  | 10.374.000    | EUR                | 14.661.480        | 15.751.380        | 2,07                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 98 -<br>01.11.29  | 553.000       | EUR                | 771.430           | 791.542           | 0,10                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 -<br>01.11.27  | 5.500.000     | EUR                | 8.333.224         | 8.358.624         | 1,10                         |
|   |               |                    | <b>96.936.321</b> | <b>98.208.458</b> | <b>12,89</b>                 |
| <b>Japan</b>  |               |                    |                   |                   |                              |
| Japan Government Five Year Bond 0,20% 12 -<br>20.09.17  | 2.417.800.000 | JPY                | 18.191.741        | 21.343.968        | 2,80                         |
| Japan Government Ten Year Bond 0,30% 15 -<br>20.12.25   | 650.000.000   | JPY                | 5.490.035         | 6.001.243         | 0,79                         |
| Japan Government Ten Year Bond 1,70% 06 -<br>20.09.16   | 4.400.000.000 | JPY                | 34.788.101        | 38.763.384        | 5,09                         |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,40% 15<br>- 20.09.45  | 628.000.000   | JPY                | 4.708.138         | 7.525.213         | 0,99                         |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,70% 03<br>- 20.06.33  | 106.600.000   | JPY                | 1.014.787         | 1.209.269         | 0,16                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |               |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                   |                   |                              |
| <b>Japan (Fortsetzung)</b>  |               |                    |                   |                   |                              |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,70% 13 - 20.12.43   | 110.000.000   | JPY                | 1.021.983         | 1.375.286         | 0,18                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 1,90% 04 - 20.03.24   | 142.100.000   | JPY                | 1.318.867         | 1.461.342         | 0,19                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,10% 01 - 22.03.21   | 121.850.000   | JPY                | 1.085.899         | 1.190.903         | 0,15                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,10% 07 - 20.12.27   | 500.000.000   | JPY                | 4.972.760         | 5.551.788         | 0,73                         |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,30% 98 - 20.09.18   | 117.800.000   | JPY                | 1.001.634         | 1.092.902         | 0,14                         |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 - 15.04.17  | 1.600.000.000 | JPY                | 13.062.755        | 14.084.124        | 1,85                         |
|   |               |                    | <b>86.656.700</b> | <b>99.599.422</b> | <b>13,07</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |               |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.18   | 519.000       | EUR                | 519.414           | 523.401           | 0,07                         |
| Netherlands Zero Coupon – 15 - 15.04.18   | 2.325.000     | EUR                | 2.342.079         | 2.349.680         | 0,31                         |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.20   | 1.093.000     | EUR                | 1.084.887         | 1.109.111         | 0,15                         |
| Netherlands Zero Coupon – 05 - 15.01.29   | 1.321.000     | EUR                | 1.118.844         | 1.265.558         | 0,17                         |
| Netherlands 0,50% 14 - 15.04.17   | 3.500.000     | EUR                | 3.528.509         | 3.530.100         | 0,46                         |
| Netherlands 1,75% 13 - 15.07.23   | 3.690.000     | EUR                | 4.132.684         | 4.220.705         | 0,55                         |
| Netherlands 3,50% 10 - 15.07.20   | 13.709.000    | EUR                | 15.964.955        | 15.977.035        | 2,10                         |
| Netherlands 4,00% 09 - 15.07.19   | 25.000.000    | EUR                | 28.652.250        | 28.499.082        | 3,74                         |
| Netherlands 5,50% 98 - 15.01.28   | 2.028.000     | EUR                | 3.095.823         | 3.292.532         | 0,43                         |
|   |               |                    | <b>60.439.445</b> | <b>60.767.204</b> | <b>7,98</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |               |                    |                   |                   |                              |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.16   | 1.012.000     | EUR                | 1.011.908         | 1.012.020         | 0,13                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.18   | 1.326.000     | EUR                | 1.319.631         | 1.325.006         | 0,18                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.19   | 851.000       | EUR                | 840.903           | 847.060           | 0,11                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.23   | 1.421.000     | EUR                | 1.299.388         | 1.333.154         | 0,18                         |
| Spain 0,25% 15 - 30.04.18   | 8.000.000     | EUR                | 8.036.467         | 8.059.250         | 1,06                         |
| Spain 4,90% 07 - 30.07.40   | 17.770.000    | EUR                | 26.815.641        | 26.992.719        | 3,54                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 15.800.000    | EUR                | 25.505.908        | 25.321.361        | 3,32                         |
| Spain 5,50% 11 - 30.04.21   | 4.144.000     | EUR                | 5.102.810         | 5.203.516         | 0,68                         |
| Spain 5,90% 11 - 30.07.26   | 212.000       | EUR                | 289.219           | 304.687           | 0,04                         |
|   |               |                    | <b>70.221.875</b> | <b>70.398.773</b> | <b>9,24</b>                  |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |               |                    |                   |                   |                              |
| United Kingdom Gilt 1,25% 13 - 22.07.18   | 6.625.000     | GBP                | 8.618.259         | 8.152.508         | 1,07                         |
| United Kingdom Gilt 1,75% 12 - 07.09.22   | 5.461.000     | GBP                | 7.275.408         | 7.047.687         | 0,93                         |
| United Kingdom Gilt 2,00% 15 - 07.09.25   | 4.909.000     | GBP                | 6.493.337         | 6.474.639         | 0,85                         |
| United Kingdom Gilt 2,25% 13 - 07.09.23   | 7.030.000     | GBP                | 9.527.801         | 9.380.282         | 1,23                         |
| United Kingdom Gilt 2,50% 15 - 22.07.65   | 12.500.000    | GBP                | 17.184.857        | 20.093.676        | 2,64                         |
| United Kingdom Gilt 3,50% 13 - 22.07.68   | 30.671.000    | GBP                | 58.536.351        | 63.873.677        | 8,38                         |
| United Kingdom Gilt 3,75% 11 - 07.09.21   | 1.942.000     | GBP                | 2.807.672         | 2.737.963         | 0,36                         |
| United Kingdom Gilt 3,75% 11 - 22.07.52   | 8.955.000     | GBP                | 15.645.895        | 17.117.851        | 2,25                         |
| United Kingdom Gilt 4,25% 06 - 07.12.27   | 10.700.000    | GBP                | 17.336.444        | 17.243.637        | 2,26                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten                  | Marktwert                        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|----------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |               |                    |                                  |                                  |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                                  |                                  |                              |
| <b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                                  |                                  |                              |
| United Kingdom Gilt 4,25% 06 - 07.12.46   | 8.962.000     | GBP                | 16.253.210<br><b>159.679.234</b> | 17.248.711<br><b>169.370.631</b> | 2,26<br><b>22,23</b>         |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |               |                    | <b>726.366.283</b>               | <b>767.094.584</b>               | <b>100,68</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |               |                    | <b>726.366.283</b>               | <b>767.094.584</b>               | <b>100,68</b>                |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |               |                    |                                  |                                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |               |                    |                                  |                                  |                              |
| <b>Kanada</b>   |               |                    |                                  |                                  |                              |
| Canada 1,50% 10 - 01.12.44  | 1.014.924     | CAD                | 1.046.249<br><b>1.046.249</b>    | 929.090<br><b>929.090</b>        | 0,12<br><b>0,12</b>          |
| <b>Italien</b>  |               |                    |                                  |                                  |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.08.29  | 1.043.000     | EUR                | 770.370                          | 820.173                          | 0,11                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.02.30  | 947.000       | EUR                | 684.535                          | 734.048                          | 0,10                         |
| Italy Government International Bond FRN 08 -<br>24.04.18  | 2.600.000.000 | JPY                | 18.021.738<br><b>19.476.643</b>  | 22.503.451<br><b>24.057.672</b>  | 2,95<br><b>3,16</b>          |
| <b>Japan</b>  |               |                    |                                  |                                  |                              |
| Japanese Government CPI Linked Bond 0,10%<br>13 - 10.09.23  | 514.500.000   | JPY                | 4.000.883<br><b>4.000.883</b>    | 4.755.722<br><b>4.755.722</b>    | 0,63<br><b>0,63</b>          |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |               |                    | <b>24.523.775</b>                | <b>29.742.484</b>                | <b>3,91</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |               |                    | <b>24.523.775</b>                | <b>29.742.484</b>                | <b>3,91</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |               |                    | <b>750.890.058</b>               | <b>796.837.068</b>               | <b>104,59</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |               |                    |                                  | <b>805.290.468</b>               | <b>105,70</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF INDONESIA GOVERNMENT UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Singapur</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| Singapore 0,50% 13 - 01.04.18   | 800.000     | SGD                | 625.186          | 587.097          | 11,54                     |
| Singapore 1,625% 14 - 01.10.19  | 1.450.000   | SGD                | 1.100.626        | 1.088.171        | 21,39                     |
| Singapore 2,00% 15 - 01.07.20   | 450.000     | SGD                | 333.100          | 342.141          | 6,72                      |
| Singapore 2,375% 10 - 01.04.17  | 1.600.000   | SGD                | 1.235.359        | 1.199.437        | 23,57                     |
| Singapore 2,50% 09 - 01.06.19   | 800.000     | SGD                | 674.316          | 614.888          | 12,09                     |
| Singapore 3,75% 01 - 01.09.16   | 1.000.000   | SGD                | 824.749          | 744.612          | 14,64                     |
| Singapore 4,00% 03 - 01.09.18   | 400.000     | SGD                | 370.016          | 315.088          | 6,19                      |
|   |             |                    | <b>5.163.352</b> | <b>4.891.434</b> | <b>96,14</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>5.163.352</b> | <b>4.891.434</b> | <b>96,14</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>5.163.352</b> | <b>4.891.434</b> | <b>96,14</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>5.163.352</b> | <b>4.891.434</b> | <b>96,14</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>4.921.192</b> | <b>96,73</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF SINGAPORE GOVERNMENT UCITS ETF\*

Anlagebestand  
zum 30. Juni 2016

(Angaben in SGD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Singapur</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Singapore 0,50% 13 - 01.04.18   | 6.500.000   | SGD                | 6.362.200         | 6.440.200         | 15,32                        |
| Singapore 1,625% 14 - 01.10.19  | 2.800.000   | SGD                | 2.844.211         | 2.836.960         | 6,75                         |
| Singapore 2,00% 15 - 01.07.20   | 3.950.000   | SGD                | 3.955.135         | 4.054.675         | 9,64                         |
| Singapore 2,375% 10 - 01.04.17  | 1.715.000   | SGD                | 1.733.007         | 1.735.752         | 4,13                         |
| Singapore 2,50% 09 - 01.06.19   | 8.360.000   | SGD                | 8.615.330         | 8.675.172         | 20,63                        |
| Singapore 3,50% 07 - 01.03.27   | 1.715.000   | SGD                | 1.766.450         | 1.964.532         | 4,67                         |
| Singapore 3,75% 01 - 01.09.16   | 7.000.000   | SGD                | 7.344.800         | 7.037.100         | 16,74                        |
| Singapore 4,00% 03 - 01.09.18   | 8.000.000   | SGD                | 8.701.100         | 8.508.000         | 20,24                        |
|   |             |                    | <b>41.322.233</b> | <b>41.252.391</b> | <b>98,12</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>41.322.233</b> | <b>41.252.391</b> | <b>98,12</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>41.322.233</b> | <b>41.252.391</b> | <b>98,12</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>41.322.233</b> | <b>41.252.391</b> | <b>98,12</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>41.551.554</b> | <b>98,83</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II SINGAPORE DOLLAR CASH UCITS ETF\*

Anlagebestand  
zum 30. Juni 2016

(Angaben in SGD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Singapur</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Singapore 0,50% 13 - 01.04.18   | 290.000     | SGD                | 289.275          | 287.332          | 24,80                        |
| Singapore 1,625% 14 - 01.10.19  | 150.000     | SGD                | 152.368          | 151.980          | 13,12                        |
| Singapore 2,00% 15 - 01.07.20   | 210.000     | SGD                | 210.273          | 215.565          | 18,60                        |
| Singapore 2,375% 10 - 01.04.17  | 145.000     | SGD                | 151.279          | 146.755          | 12,66                        |
| Singapore 3,75% 01 - 01.09.16   | 75.000      | SGD                | 79.410           | 75.398           | 6,51                         |
| Singapore 4,00% 03 - 01.09.18   | 215.000     | SGD                | 252.732          | 228.652          | 19,73                        |
|   |             |                    | <b>1.135.337</b> | <b>1.105.682</b> | <b>95,42</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>1.135.337</b> | <b>1.105.682</b> | <b>95,42</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>1.135.337</b> | <b>1.105.682</b> | <b>95,42</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>1.135.337</b> | <b>1.105.682</b> | <b>95,42</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>1.113.388</b> | <b>96,08</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX £ GILTS 1-5 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in GBP)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| United Kingdom Gilt 1,00% 12 - 07.09.17   | 500.000     | GBP                | 495.675          | 504.739          | 8,57                         |
| United Kingdom Gilt 1,75% 11 - 22.01.17   | 75.000      | GBP                | 76.583           | 75.660           | 1,28                         |
| United Kingdom Gilt 1,75% 13 - 22.07.19   | 1.100.000   | GBP                | 1.120.797        | 1.151.324        | 19,54                        |
| United Kingdom Gilt 2,00% 14 - 22.07.20   | 1.200.000   | GBP                | 1.242.216        | 1.280.770        | 21,74                        |
| United Kingdom Gilt 3,75% 11 - 07.09.21   | 1.450.000   | GBP                | 1.640.726        | 1.698.924        | 28,83                        |
| United Kingdom Gilt 4,00% 06 - 07.09.16   | 20.000      | GBP                | 21.024           | 20.135           | 0,34                         |
| United Kingdom Gilt 4,25% 10 - 07.12.40   | 20.000      | GBP                | 24.266           | 30.166           | 0,51                         |
| United Kingdom Gilt 4,50% 08 - 07.03.19   | 300.000     | GBP                | 342.963          | 335.689          | 5,70                         |
| United Kingdom Gilt 5,00% 07 - 07.03.18   | 488.000     | GBP                | 548.295          | 528.610          | 8,97                         |
| United Kingdom Gilt 8,75% 92 - 25.08.17   | 75.000      | GBP                | 96.247           | 82.454           | 1,40                         |
|   |             |                    | <b>5.608.792</b> | <b>5.708.471</b> | <b>96,88</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>5.608.792</b> | <b>5.708.471</b> | <b>96,88</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>5.608.792</b> | <b>5.708.471</b> | <b>96,88</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>5.608.792</b> | <b>5.708.471</b> | <b>96,88</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>5.761.442</b> | <b>97,78</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|-----------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| United States Treasury Notes 0,625% 15 -<br>30.06.17  | 3.449.300   | USD                | 3.448.020       | 3.452.264 | 1,98                         |
| United States Treasury Notes 0,75% 16 -<br>15.02.19   | 3.639.200   | USD                | 3.616.311       | 3.645.739 | 2,09                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 14 -<br>15.06.17  | 1.164.700   | USD                | 1.166.340       | 1.168.522 | 0,67                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 15 -<br>30.11.17  | 3.983.400   | USD                | 3.987.056       | 3.998.960 | 2,29                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 15 -<br>15.07.18  | 4.588.100   | USD                | 4.585.783       | 4.612.474 | 2,65                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 15 -<br>15.10.18  | 4.513.600   | USD                | 4.507.562       | 4.536.521 | 2,60                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 14 -<br>15.09.17   | 4.229.300   | USD                | 4.240.737       | 4.250.777 | 2,44                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 15 -<br>15.02.18   | 4.432.800   | USD                | 4.443.975       | 4.461.544 | 2,56                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 15 -<br>15.03.18   | 3.769.600   | USD                | 3.785.217       | 3.794.632 | 2,18                         |
| United States Treasury Notes 1,125% 16 -<br>15.01.19  | 834.500     | USD                | 839.958         | 843.693   | 0,48                         |
| United States Treasury Notes 1,25% 15 -<br>15.11.18   | 2.091.900   | USD                | 2.112.215       | 2.121.154 | 1,22                         |
| United States Treasury Notes 1,25% 15 -<br>31.01.20   | 1.791.300   | USD                | 1.795.366       | 1.817.330 | 1,04                         |
| United States Treasury Notes 1,375% 15 -<br>29.02.20  | 2.790.600   | USD                | 2.823.123       | 2.843.360 | 1,63                         |
| United States Treasury Notes 1,375% 15 -<br>30.04.20  | 3.581.500   | USD                | 3.600.225       | 3.649.213 | 2,09                         |
| United States Treasury Notes 1,50% 14 -<br>31.05.19   | 2.649.000   | USD                | 2.684.066       | 2.708.189 | 1,55                         |
| United States Treasury Notes 1,50% 16 -<br>28.02.23   | 2.049.000   | USD                | 2.030.304       | 2.077.654 | 1,19                         |
| United States Treasury Notes 1,50% 16 -<br>31.03.23   | 1.815.100   | USD                | 1.814.875       | 1.842.043 | 1,06                         |
| United States Treasury Notes 1,625% 14 -<br>31.03.19  | 3.375.400   | USD                | 3.431.214       | 3.460.049 | 1,98                         |
| United States Treasury Notes 1,625% 14 -<br>31.08.19  | 3.983.400   | USD                | 4.050.020       | 4.090.765 | 2,35                         |
| United States Treasury Notes 1,625% 15 -<br>30.11.20  | 3.983.400   | USD                | 4.037.293       | 4.100.724 | 2,35                         |
| United States Treasury Notes 1,625% 16 -<br>15.02.26  | 1.312.500   | USD                | 1.291.401       | 1.328.188 | 0,76                         |
| United States Treasury Notes 1,75% 14 -<br>30.09.19   | 3.221.300   | USD                | 3.301.511       | 3.321.462 | 1,91                         |
| United States Treasury Notes 1,75% 15 -<br>31.12.20   | 3.498.600   | USD                | 3.585.447       | 3.618.591 | 2,08                         |
| United States Treasury Notes 1,75% 15 -<br>28.02.22   | 1.447.500   | USD                | 1.464.306       | 1.496.353 | 0,86                         |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR) (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|-----------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| United States Treasury Notes 1,75% 15 - 30.09.22  | 3.353.400   | USD                | 3.380.304       | 3.459.766 | 1,98                         |
| United States Treasury Notes 1,75% 13 - 15.05.23  | 1.447.500   | USD                | 1.456.313       | 1.493.865 | 0,86                         |
| United States Treasury Notes 1,875% 15 - 31.05.22   | 3.259.600   | USD                | 3.316.538       | 3.390.748 | 1,95                         |
| United States Treasury Notes 2,00% 12 - 15.02.19  | 3.138.000   | USD                | 3.226.885       | 3.286.810 | 1,89                         |
| United States Treasury Notes 2,00% 14 - 28.02.21  | 3.390.400   | USD                | 3.490.009       | 3.547.206 | 2,04                         |
| United States Treasury Notes 2,00% 14 - 31.05.21  | 519.800     | USD                | 538.663         | 544.247   | 0,31                         |
| United States Treasury Notes 2,00% 15 - 15.02.25  | 1.201.000   | USD                | 1.223.261       | 1.257.391 | 0,72                         |
| United States Treasury Notes 2,00% 15 - 15.08.25  | 1.861.900   | USD                | 1.884.678       | 1.947.867 | 1,12                         |
| United States Treasury Notes 2,125% 13 - 31.08.20   | 3.364.900   | USD                | 3.477.864       | 3.529.465 | 2,02                         |
| United States Treasury Notes 2,125% 14 - 30.09.21   | 3.500.200   | USD                | 3.616.054       | 3.689.156 | 2,12                         |
| United States Treasury Notes 2,125% 14 - 31.12.21   | 2.049.000   | USD                | 2.115.572       | 2.160.574 | 1,24                         |
| United States Treasury Notes 2,125% 15 - 15.05.25   | 1.162.400   | USD                | 1.202.999       | 1.228.693 | 0,70                         |
| United States Treasury Notes 2,25% 14 - 30.04.21  | 1.727.100   | USD                | 1.796.468       | 1.827.893 | 1,05                         |
| United States Treasury Notes 2,25% 15 - 15.11.25  | 1.207.000   | USD                | 1.246.605       | 1.288.567 | 0,74                         |
| United States Treasury Notes 2,375% 14 - 15.08.24   | 2.741.300   | USD                | 2.864.391       | 2.952.466 | 1,69                         |
| United States Treasury Notes 2,50% 13 - 15.08.23  | 1.931.100   | USD                | 2.039.515       | 2.092.528 | 1,20                         |
| United States Treasury Notes 2,50% 15 - 15.02.45  | 1.328.500   | USD                | 1.282.686       | 1.390.255 | 0,80                         |
| United States Treasury Notes 2,50% 16 - 15.02.46  | 653.300     | USD                | 634.758         | 683.821   | 0,39                         |
| United States Treasury Notes 2,625% 10 - 15.11.20   | 1.018.500   | USD                | 1.073.884       | 1.088.840 | 0,62                         |
| United States Treasury Notes 2,625% 10 - 15.02.22   | 1.364.700   | USD                | 1.440.885       | 1.462.041 | 0,84                         |
| United States Treasury Notes 2,75% 14 - 15.02.24  | 2.369.000   | USD                | 2.557.741       | 2.615.709 | 1,50                         |
| United States Treasury Notes 2,75% 12 - 15.08.42  | 1.207.000   | USD                | 1.236.107       | 1.335.621 | 0,77                         |
| United States Treasury Notes 3,00% 14 - 15.11.44  | 1.207.000   | USD                | 1.290.695       | 1.394.462 | 0,80                         |
| United States Treasury Notes 3,125% 09 - 15.08.20   | 1.358.700   | USD                | 1.440.696       | 1.452.323 | 0,83                         |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR) (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|-----------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| United States Treasury Notes 3,125% 11 -<br>15.11.41  | 1.546.000   | USD                | 1.720.043       | 1.834.788 | 1,05                         |
| United States Treasury Notes 3,125% 12 -<br>15.02.42  | 1.580.000   | USD                | 1.744.483       | 1.876.003 | 1,08                         |
| United States Treasury Notes 3,125% 13 -<br>15.02.43  | 1.328.500   | USD                | 1.459.363       | 1.573.235 | 0,90                         |
| United States Treasury Notes 3,375% 14 -<br>15.05.44  | 2.214.300   | USD                | 2.597.788       | 2.742.099 | 1,57                         |
| United States Treasury Notes 3,50% 10 -<br>15.05.20   | 1.616.400   | USD                | 1.759.656       | 1.776.777 | 1,02                         |
| United States Treasury Notes 3,625% 14 -<br>15.02.44  | 1.207.000   | USD                | 1.451.219       | 1.563.254 | 0,90                         |
| United States Treasury Notes 3,75% 08 -<br>15.11.18   | 1.348.600   | USD                | 1.438.497       | 1.447.533 | 0,83                         |
| United States Treasury Notes 3,75% 13 -<br>15.11.43   | 1.336.600   | USD                | 1.650.985       | 1.771.308 | 1,02                         |
| United States Treasury Notes 3,875% 08 -<br>15.05.18  | 3.172.700   | USD                | 3.358.096       | 3.369.011 | 1,93                         |
| United States Treasury Notes 4,00% 08 -<br>15.05.19   | 1.334.500   | USD                | 1.424.903       | 1.431.877 | 0,82                         |
| United States Treasury Notes 4,25% 10 -<br>15.11.40   | 1.066.000   | USD                | 1.398.340       | 1.498.230 | 0,86                         |
| United States Treasury Notes 4,375% 10 -<br>15.05.40  | 1.861.100   | USD                | 2.529.580       | 2.657.011 | 1,52                         |
| United States Treasury Notes 4,375% 11 -<br>15.05.41  | 894.900     | USD                | 1.196.569       | 1.283.063 | 0,74                         |
| United States Treasury Notes 4,50% 06 -<br>15.02.36   | 589.200     | USD                | 802.898         | 851.900   | 0,49                         |
| United States Treasury Notes 4,50% 08 -<br>15.05.38   | 720.500     | USD                | 980.675         | 1.048.890 | 0,60                         |
| United States Treasury Notes 4,50% 09 -<br>15.08.39   | 1.567.100   | USD                | 2.126.750       | 2.274.131 | 1,30                         |
| United States Treasury Notes 4,625% 10 -<br>15.02.40  | 1.328.500   | USD                | 1.833.172       | 1.960.783 | 1,12                         |
| United States Treasury Notes 4,75% 11 -<br>15.02.41   | 663.000     | USD                | 932.869         | 998.229   | 0,57                         |
| United States Treasury Notes 5,00% 07 -<br>15.05.37   | 928.700     | USD                | 1.353.484       | 1.432.955 | 0,82                         |
| United States Treasury Notes 5,25% 99 -<br>15.02.29   | 339.700     | USD                | 467.117         | 481.180   | 0,28                         |
| United States Treasury Notes 5,375% 01 -<br>15.02.31  | 125.600     | USD                | 177.742         | 186.673   | 0,11                         |
| United States Treasury Notes 6,125% 97 -<br>15.11.27  | 720.500     | USD                | 1.024.461       | 1.065.045 | 0,61                         |
| United States Treasury Notes 6,25% 93 -<br>15.08.18   | 1.218.800   | USD                | 1.599.869       | 1.633.668 | 0,94                         |
| United States Treasury Notes 6,25% 00 -<br>15.05.30   | 483.200     | USD                | 727.207         | 760.889   | 0,44                         |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR) (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>                 |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| United States Treasury Notes 6,50% 96 -<br>15.11.26   | 749.600     | USD                | 1.077.886          | 1.110.521          | 0,64                         |
| United States Treasury Notes 6,625% 97 -<br>15.02.27  | 237.300     | USD                | 344.570            | 356.766            | 0,20                         |
| United States Treasury Notes 7,50% 94 -<br>15.11.24   | 268.500     | USD                | 390.635            | 399.289            | 0,23                         |
| United States Treasury Notes 8,00% 91 -<br>15.11.21   | 1.739.500   | USD                | 2.332.809          | 2.369.389          | 1,36                         |
| United States Treasury Notes 8,75% 90 -<br>15.08.23   | 1.625.400   | USD                | 2.115.880          | 2.142.988          | 1,23                         |
| United States Treasury Notes 8,875% 89 -<br>15.02.19  | 1.020.500   | USD                | 1.231.397          | 1.239.509          | 0,71                         |
|   |             |                    | <b>163.724.839</b> | <b>167.497.509</b> | <b>96,08</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>163.724.839</b> | <b>167.497.509</b> | <b>96,08</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>163.724.839</b> | <b>167.497.509</b> | <b>96,08</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>             |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| United States Treasury Notes 0,625% 15 -<br>31.07.17  | 4.229.300   | USD                | 4.223.968          | 4.232.935          | 2,43                         |
| United States Treasury Notes 3,00% 15 -<br>15.11.45   | 1.207.000   | USD                | 1.290.161          | 1.394.839          | 0,80                         |
|   |             |                    | <b>5.514.129</b>   | <b>5.627.774</b>   | <b>3,23</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>5.514.129</b>   | <b>5.627.774</b>   | <b>3,23</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare<br/>Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>5.514.129</b>   | <b>5.627.774</b>   | <b>3,23</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>169.238.968</b> | <b>173.125.283</b> | <b>99,31</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>174.032.954</b> | <b>99,83</b>                 |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II UK GILTS SHORT DAILY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in GBP)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| UniCredit Bank Austria AG FRN 01 - 25.01.31   | 2.000.000   | EUR                | 1.311.227         | 1.002.989         | 8,69                         |
| UniCredit Bank Austria AG FRN 01 - 20.08.33   | 3.000.000   | EUR                | 1.822.040         | 1.508.358         | 13,08                        |
|   |             |                    | <b>3.133.267</b>  | <b>2.511.347</b>  | <b>21,77</b>                 |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 1.842.000   | EUR                | 2.059.781         | 2.525.809         | 21,89                        |
|   |             |                    | <b>2.059.781</b>  | <b>2.525.809</b>  | <b>21,89</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Ireland 2,00% 15 - 18.02.45   | 2.800.000   | EUR                | 1.795.861         | 2.739.803         | 23,75                        |
|   |             |                    | <b>1.795.861</b>  | <b>2.739.803</b>  | <b>23,75</b>                 |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| United Kingdom Gilt 3,25% 12 - 22.01.44   | 1.550.000   | GBP                | 1.942.240         | 2.059.534         | 17,86                        |
| United Kingdom Gilt 4,00% 09 - 22.01.60   | 1.500.000   | GBP                | 2.550.081         | 2.690.273         | 23,32                        |
| United Kingdom Gilt 4,25% 09 - 07.09.39   | 1.000       | GBP                | 1.307             | 1.487             | 0,01                         |
| United Kingdom Gilt 4,25% 10 - 07.12.40   | 300.000     | GBP                | 361.284           | 452.492           | 3,92                         |
|   |             |                    | <b>4.854.912</b>  | <b>5.203.786</b>  | <b>45,11</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>11.843.821</b> | <b>12.980.745</b> | <b>112,52</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>11.843.821</b> | <b>12.980.745</b> | <b>112,52</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>11.843.821</b> | <b>12.980.745</b> | <b>112,52</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>13.063.985</b> | <b>113,24</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|-----------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 14 - 15.04.19                            | 891.170     | USD                | 907.973         | 910.036   | 4,39                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 15 - 15.04.20                            | 898.027     | USD                | 914.089         | 918.934   | 4,43                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 12 - 15.01.22                            | 762.159     | USD                | 770.518         | 776.687   | 3,75                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 14 - 15.07.24                            | 726.501     | USD                | 727.336         | 733.936   | 3,54                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,25% 15 - 15.01.25                             | 728.311     | USD                | 732.225         | 739.463   | 3,57                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,375% 13 - 15.07.23                            | 734.881     | USD                | 754.681         | 760.141   | 3,67                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,625% 11 - 15.07.21                            | 664.649     | USD                | 694.270         | 699.385   | 3,37                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,625% 13 - 15.02.43                            | 418.281     | USD                | 393.666         | 407.303   | 1,97                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,75% 15 - 15.02.45                             | 408.388     | USD                | 394.809         | 410.525   | 1,98                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,125% 11 - 15.01.21                            | 699.782     | USD                | 746.792         | 748.220   | 3,61                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,25% 10 - 15.07.20                             | 618.559     | USD                | 664.264         | 664.372   | 3,21                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,375% 08 - 15.07.18                            | 290.652     | USD                | 306.742         | 304.845   | 1,47                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,375% 10 - 15.01.20                            | 366.172     | USD                | 391.636         | 391.089   | 1,89                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,375% 14 - 15.02.44                            | 412.530     | USD                | 461.213         | 477.151   | 2,30                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,625% 08 - 15.01.18                            | 327.725     | USD                | 343.192         | 340.135   | 1,64                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,75% 08 - 15.01.28                             | 312.881     | USD                | 363.173         | 365.800   | 1,76                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,875% 09 - 15.07.19                            | 296.903     | USD                | 322.595         | 321.305   | 1,55                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,00% 06 - 15.01.26                             | 420.646     | USD                | 493.943         | 494.819   | 2,39                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,125% 09 - 15.01.19                            | 287.469     | USD                | 310.123         | 308.333   | 1,49                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,125% 10 - 15.02.40                            | 293.302     | USD                | 374.706         | 383.787   | 1,85                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,125% 11 - 15.02.41                            | 462.190     | USD                | 592.977         | 610.051   | 2,94                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,375% 04 - 15.01.25                            | 619.580     | USD                | 741.084         | 739.722   | 3,57                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,375% 07 - 15.01.27                            | 342.823     | USD                | 419.326         | 420.682   | 2,03                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,50% 09 - 15.01.29                             | 275.212     | USD                | 345.195         | 348.595   | 1,68                         |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR) (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>2,625% 07 - 15.07.17  | 282.904     | USD                | 298.190           | 294.455           | 1,42                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>3,375% 01 - 15.04.32  | 117.253     | USD                | 170.432           | 171.712           | 0,83                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>3,625% 98 - 15.04.28  | 434.844     | USD                | 603.128           | 601.650           | 2,90                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>3,875% 99 - 15.04.29  | 502.041     | USD                | 723.133           | 723.017           | 3,49                         |
|   |             |                    | <b>14.961.411</b> | <b>15.066.150</b> | <b>72,69</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>14.961.411</b> | <b>15.066.150</b> | <b>72,69</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>14.961.411</b> | <b>15.066.150</b> | <b>72,69</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 13 - 15.04.18  | 905.313     | USD                | 919.945           | 918.660           | 4,43                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 16 - 15.04.21  | 280.599     | USD                | 285.754           | 287.373           | 1,39                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 12 - 15.07.22  | 750.139     | USD                | 761.498           | 766.839           | 3,70                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,125% 13 - 15.01.23  | 747.348     | USD                | 752.136           | 757.216           | 3,65                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,375% 15 - 15.07.25  | 727.424     | USD                | 740.923           | 748.735           | 3,61                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,625% 14 - 15.01.24  | 739.315     | USD                | 768.117           | 774.085           | 3,74                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,625% 16 - 15.01.26  | 691.356     | USD                | 719.549           | 727.651           | 3,51                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>0,75% 12 - 15.02.42   | 428.769     | USD                | 416.472           | 429.878           | 2,08                         |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds<br>1,00% 16 - 15.02.46   | 167.496     | USD                | 174.483           | 180.895           | 0,87                         |
|   |             |                    | <b>5.538.877</b>  | <b>5.591.332</b>  | <b>26,98</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>5.538.877</b>  | <b>5.591.332</b>  | <b>26,98</b>                 |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>5.538.877</b>  | <b>5.591.332</b>  | <b>26,98</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>20.500.288</b> | <b>20.657.482</b> | <b>99,67</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>20.732.051</b> | <b>100,03</b>                |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II US TREASURIES SHORT DAILY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Austria 4,65% 03 - 15.01.18   | 500.000     | EUR                | 798.928          | 599.929          | 12,26                        |
|   |             |                    | <b>798.928</b>   | <b>599.929</b>   | <b>12,26</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Ireland 2,00% 15 - 18.02.45   | 1.000.000   | EUR                | 984.774          | 1.308.060        | 26,73                        |
|   |             |                    | <b>984.774</b>   | <b>1.308.060</b> | <b>26,73</b>                 |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,50%<br>12 - 20.03.17  | 400.000     | EUR                | 555.869          | 454.214          | 9,28                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 07 -<br>01.08.39  | 650.000     | EUR                | 976.431          | 1.096.428        | 22,41                        |
|   |             |                    | <b>1.532.300</b> | <b>1.550.642</b> | <b>31,69</b>                 |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Spain 4,70% 09 - 30.07.41   | 600.000     | EUR                | 824.902          | 992.650          | 20,28                        |
|   |             |                    | <b>824.902</b>   | <b>992.650</b>   | <b>20,28</b>                 |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| European Investment Bank 4,50% 09 -<br>15.10.25   | 500.000     | EUR                | 738.944          | 783.729          | 16,02                        |
|   |             |                    | <b>738.944</b>   | <b>783.729</b>   | <b>16,02</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>4.879.848</b> | <b>5.235.010</b> | <b>106,98</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>4.879.848</b> | <b>5.235.010</b> | <b>106,98</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>4.879.848</b> | <b>5.235.010</b> | <b>106,98</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>5.320.972</b> | <b>108,74</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF (DR)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|-----------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                 |           |                              |
| United States Treasury Notes 0,625% 15 -<br>30.06.17  | 993.000     | USD                | 991.869         | 993.853   | 1,87                         |
| United States Treasury Notes 0,625% 12 -<br>31.08.17  | 2.156.400   | USD                | 2.154.548       | 2.158.085 | 4,06                         |
| United States Treasury Notes 0,625% 12 -<br>30.09.17  | 2.156.400   | USD                | 2.151.675       | 2.158.253 | 4,06                         |
| United States Treasury Notes 0,625% 12 -<br>31.10.17  | 2.156.400   | USD                | 2.152.911       | 2.157.916 | 4,06                         |
| United States Treasury Notes 0,75% 12 -<br>28.02.18   | 2.156.400   | USD                | 2.155.075       | 2.161.286 | 4,07                         |
| United States Treasury Notes 0,75% 16 -<br>15.02.19   | 1.466.000   | USD                | 1.455.886       | 1.468.634 | 2,76                         |
| United States Treasury Notes 0,75% 16 -<br>15.05.19   | 1.021.500   | USD                | 1.019.332       | 1.024.293 | 1,93                         |
| United States Treasury Notes 0,75% 13 -<br>04.09.21   | 2.156.400   | USD                | 2.152.916       | 2.161.791 | 4,07                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 14 -<br>15.08.17  | 1.541.500   | USD                | 1.543.330       | 1.547.040 | 2,91                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 14 -<br>15.10.17  | 1.541.500   | USD                | 1.542.797       | 1.547.401 | 2,91                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 15 -<br>30.11.17  | 1.522.700   | USD                | 1.523.816       | 1.528.648 | 2,88                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 16 -<br>31.05.18  | 756.500     | USD                | 753.397         | 760.105   | 1,43                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 15 -<br>15.07.18  | 1.484.800   | USD                | 1.483.536       | 1.492.688 | 2,81                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 16 -<br>31.08.18  | 567.600     | USD                | 567.659         | 570.571   | 1,07                         |
| United States Treasury Notes 0,875% 15 -<br>15.10.18  | 1.466.000   | USD                | 1.463.466       | 1.473.445 | 2,77                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 15 -<br>31.12.17   | 1.522.700   | USD                | 1.526.363       | 1.531.860 | 2,88                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 15 -<br>15.02.18   | 1.418.700   | USD                | 1.421.719       | 1.427.899 | 2,69                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 15 -<br>15.03.18   | 1.134.900   | USD                | 1.137.331       | 1.142.436 | 2,15                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 15 -<br>15.05.18   | 1.484.800   | USD                | 1.487.188       | 1.495.704 | 2,82                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 15 -<br>15.08.18   | 945.700     | USD                | 950.062         | 953.014   | 1,79                         |
| United States Treasury Notes 1,00% 16 -<br>15.03.19   | 1.295.600   | USD                | 1.300.311       | 1.306.430 | 2,46                         |
| United States Treasury Notes 1,125% 15 -<br>15.06.18  | 1.466.000   | USD                | 1.472.100       | 1.480.431 | 2,79                         |
| United States Treasury Notes 1,375% 11 -<br>30.09.18  | 1.702.500   | USD                | 1.719.230       | 1.730.432 | 3,26                         |
| United States Treasury Notes 1,50% 11 -<br>31.05.17   | 2.213.100   | USD                | 2.241.019       | 2.254.423 | 4,24                         |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF (DR) (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>                 |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| United States Treasury Notes 1,50% 13 -<br>31.12.18   | 1.418.700   | USD                | 1.437.162         | 1.447.850         | 2,73                         |
| United States Treasury Notes 1,50% 14 -<br>31.01.19   | 1.607.900   | USD                | 1.628.381         | 1.641.440         | 3,09                         |
| United States Treasury Notes 2,25% 11 -<br>31.07.18   | 331.100     | USD                | 340.363           | 342.301           | 0,64                         |
| United States Treasury Notes 2,75% 09 -<br>30.04.18   | 2.061.800   | USD                | 2.158.391         | 2.173.266         | 4,09                         |
| United States Treasury Notes 2,875% 11 -<br>31.03.18  | 1.560.600   | USD                | 1.615.114         | 1.621.927         | 3,05                         |
| United States Treasury Notes 3,125% 09 -<br>15.05.19  | 1.797.100   | USD                | 1.905.048         | 1.920.932         | 3,62                         |
| United States Treasury Notes 3,50% 08 -<br>15.02.18   | 1.711.900   | USD                | 1.788.077         | 1.792.279         | 3,37                         |
| United States Treasury Notes 3,75% 08 -<br>15.11.18   | 2.023.900   | USD                | 2.156.873         | 2.172.372         | 4,09                         |
| United States Treasury Notes 4,75% 07 -<br>15.08.17   | 473.000     | USD                | 494.850           | 495.061           | 0,93                         |
| United States Treasury Notes 8,875% 89 -<br>15.02.19  | 1.087.600   | USD                | 1.314.887         | 1.321.009         | 2,49                         |
|   |             |                    | <b>51.206.682</b> | <b>51.455.075</b> | <b>96,84</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>51.206.682</b> | <b>51.455.075</b> | <b>96,84</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>51.206.682</b> | <b>51.455.075</b> | <b>96,84</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>             |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| United States Treasury Notes 0,625% 15 -<br>31.07.17  | 1.362.000   | USD                | 1.360.092         | 1.363.171         | 2,56                         |
|   |             |                    | <b>1.360.092</b>  | <b>1.363.171</b>  | <b>2,56</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>1.360.092</b>  | <b>1.363.171</b>  | <b>2,56</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare<br/>Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>1.360.092</b>  | <b>1.363.171</b>  | <b>2,56</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>52.566.774</b> | <b>52.818.246</b> | <b>99,40</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>53.026.996</b> | <b>99,79</b>                 |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                  |                              |
| <b>Australien</b>   |             |                    |                   |                  |                              |
| Commonwealth Bank of Australia 3,00% 12 - 03.05.22  | 400.000     | EUR                | 464.704           | 467.109          | 0,17                         |
| Commonwealth Bank of Australia 4,25% 09 - 10.11.16  | 127.000     | EUR                | 134.543           | 128.916          | 0,05                         |
| National Australia Bank Ltd. 1,875% 12 - 13.01.23   | 1.000.000   | EUR                | 1.063.970         | 1.110.813        | 0,42                         |
| National Australia Bank Ltd. 2,00% 13 - 12.11.20  | 102.000     | EUR                | 108.808           | 109.800          | 0,04                         |
| National Australia Bank Ltd. 2,75% 12 - 08.08.22  | 2.000.000   | EUR                | 2.162.960         | 2.266.457        | 0,85                         |
| National Australia Bank Ltd. 3,75% 11 - 06.01.17  | 1.800.000   | EUR                | 1.938.816         | 1.835.262        | 0,69                         |
| National Australia Bank Ltd. 4,00% 10 - 13.07.20  | 110.000     | EUR                | 128.379           | 127.011          | 0,05                         |
| Westpac Banking Corp.   | 500.000     | EUR                | 531.636           | 534.461          | 0,20                         |
|   |             |                    | <b>6.533.816</b>  | <b>6.579.829</b> | <b>2,47</b>                  |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                  |                              |
| Telekom Finanzmanagement GmbH 3.125% 13 - 03.12.21  | 1.087.000   | EUR                | 1.226.584         | 1.240.014        | 0,47                         |
|   |             |                    | <b>1.226.584</b>  | <b>1.240.014</b> | <b>0,47</b>                  |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                  |                              |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV 1,50% 15 - 18.04.30  | 2.111.000   | EUR                | 2.079.970         | 2.128.102        | 0,80                         |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV 4,00% 13 - 24.09.25  | 1.698.000   | GBP                | 2.601.072         | 2.331.668        | 0,88                         |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV 6,50% 09 - 23.06.17  | 3.987.000   | GBP                | 6.149.387         | 5.042.780        | 1,90                         |
| BNP Paribas Fortis SA 5.757% 07 - 04.10.17  | 109.000     | EUR                | 121.739           | 116.307          | 0,04                         |
|   |             |                    | <b>10.952.168</b> | <b>9.618.857</b> | <b>3,62</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                  |                              |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 2,00% 13 - 19.09.19   | 700.000     | EUR                | 741.746           | 741.752          | 0,28                         |
| BNP Paribas SA 2,375% 14 - 20.05.24   | 5.000.000   | EUR                | 5.068.700         | 5.631.940        | 2,12                         |
| BNP Paribas SA 2,50% 12 - 23.08.19  | 1.000.000   | EUR                | 1.086.960         | 1.073.904        | 0,40                         |
| BNP Paribas SA 3,75% 10 - 25.11.20  | 563.000     | EUR                | 651.391           | 649.476          | 0,24                         |
| BNP Paribas SA 5.431% 07 - 07.09.17   | 128.000     | EUR                | 141.811           | 135.574          | 0,05                         |
| BPCE SA 4.625% 13 - 18.07.23  | 400.000     | EUR                | 462.765           | 460.172          | 0,17                         |
| Carrefour SA 1,75% 13 - 22.05.19  | 293.000     | EUR                | 305.795           | 307.216          | 0,12                         |
| Carrefour SA 4,00% 10 - 09.04.20  | 1.270.000   | EUR                | 1.489.265         | 1.454.057        | 0,55                         |
| Casino Guichard Perrachon SA 3,311% 13 - 25.01.23   | 300.000     | EUR                | 314.499           | 321.591          | 0,12                         |
| Cie de Saint-Gobain 4,50% 11 - 30.09.19   | 278.000     | EUR                | 322.194           | 317.391          | 0,12                         |
| Danone SA 2,25% 13 - 15.11.21   | 300.000     | EUR                | 322.746           | 332.092          | 0,12                         |
| Electricite de France SA 2,75% 12 - 10.03.23  | 500.000     | EUR                | 576.055           | 570.098          | 0,21                         |
| Electricite de France SA 5,50% 01 - 25.10.16  | 765.000     | EUR                | 824.387           | 777.852          | 0,29                         |
| Engie SA 1,50% 12 - 20.07.17  | 1.087.000   | EUR                | 1.104.188         | 1.104.511        | 0,42                         |
| Engie SA 2,25% 12 - 01.06.18  | 300.000     | EUR                | 317.337           | 313.580          | 0,12                         |
| Engie SA 6.375% 09 - 18.01.21   | 2.500.000   | EUR                | 3.241.225         | 3.218.039        | 1,21                         |
| Engie SA 6.875% 08 - 24.01.19   | 44.000      | EUR                | 53.706            | 51.855           | 0,02                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Frankreich (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Eutelsat SA 2.625% 13 - 13.01.20  | 300.000     | EUR                | 321.522           | 318.772           | 0,12                         |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.02.18  | 1.700.000   | EUR                | 1.711.142         | 1.715.544         | 0,65                         |
| France OAT 1,75% 14 - 25.11.24  | 7.400.000   | EUR                | 8.368.936         | 8.484.151         | 3,19                         |
| HSBC France SA 1.875% 13 - 16.01.20   | 1.600.000   | EUR                | 1.705.419         | 1.691.192         | 0,64                         |
| Kering 1.875% 13 - 08.10.18   | 300.000     | EUR                | 313.554           | 312.626           | 0,12                         |
| Orange SA 3,00% 12 - 15.06.22   | 300.000     | EUR                | 339.669           | 347.402           | 0,13                         |
| Orange SA 3,875% 10 - 09.04.20  | 1.400.000   | EUR                | 1.614.094         | 1.598.277         | 0,60                         |
| Orange SA 3,875% 10 - 14.01.21  | 2.350.000   | EUR                | 2.796.359         | 2.745.980         | 1,03                         |
| Orange SA 4,125% 11 - 14.09.21  | 500.000     | USD                | 480.807           | 496.013           | 0,19                         |
| Orange SA 8.125% 03 - 28.01.33  | 150.000     | EUR                | 251.360           | 287.826           | 0,11                         |
| Pernod Ricard SA 2,00% 14 - 22.06.20  | 300.000     | EUR                | 315.651           | 320.614           | 0,12                         |
| Renault SA 3.625% 13 - 19.09.18   | 1.304.000   | EUR                | 1.398.193         | 1.404.755         | 0,53                         |
| Sanofi 1,00% 12 - 14.11.17  | 1.087.000   | EUR                | 1.102.262         | 1.103.223         | 0,41                         |
| Schneider Electric SE 4,00% 05 - 11.08.17   | 37.000      | EUR                | 39.545            | 38.656            | 0,01                         |
| Total Capital International SA 1,375% 14 - 19.03.25   | 1.300.000   | EUR                | 1.335.633         | 1.390.622         | 0,52                         |
| Total Capital International SA 2.125% 13 - 19.11.21   | 300.000     | EUR                | 322.983           | 332.188           | 0,12                         |
| Total Capital SA 4.875% 09 - 28.01.19   | 44.000      | EUR                | 50.861            | 49.656            | 0,02                         |
| Veolia Environnement SA 4.375% 06 - 16.01.17  | 29.000      | EUR                | 30.574            | 29.671            | 0,01                         |
| Vinci SA 4.125% 11 - 20.02.17   | 300.000     | EUR                | 320.487           | 307.872           | 0,12                         |
|   |             |                    | <b>39.843.821</b> | <b>40.436.140</b> | <b>15,20</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| BASF SE 2,00% 12 - 05.12.22   | 1.827.000   | EUR                | 2.003.770         | 2.030.978         | 0,76                         |
| BASF SE 2,50% 14 - 22.01.24   | 3.000.000   | EUR                | 3.334.740         | 3.440.726         | 1,29                         |
| Commerzbank AG 1,00% 14 - 05.02.19  | 900.000     | EUR                | 905.769           | 928.851           | 0,35                         |
| Commerzbank AG 3,625% 12 - 10.07.17   | 95.000      | EUR                | 101.608           | 98.458            | 0,04                         |
| Commerzbank AG 3,875% 10 - 22.03.17   | 10.000      | EUR                | 10.269            | 10.277            | 0,00                         |
| Continental AG 3.125% 13 - 09.09.20   | 1.087.000   | EUR                | 1.212.226         | 1.220.129         | 0,46                         |
| Daimler AG 0,625% 15 - 05.03.20   | 500.000     | EUR                | 499.922           | 509.905           | 0,19                         |
| Daimler AG 1,00% 13 - 08.07.16  | 156.000     | EUR                | 157.434           | 156.012           | 0,06                         |
| Daimler AG 1,40% 16 - 12.01.24  | 1.449.000   | EUR                | 1.512.974         | 1.544.433         | 0,58                         |
| Deutsche Bundespost Zero Coupon – 90 - 31.12.19   | 22.585.000  | EUR                | 11.114.041        | 11.589.560        | 4,36                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.16   | 5.200.000   | EUR                | 5.200.215         | 5.200.000         | 1,96                         |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 7,625% 93 - 01.02.23  | 2.000.000   | USD                | 2.342.209         | 2.307.126         | 0,87                         |
| Linde AG 1,75% 12 - 17.09.20  | 1.940.000   | EUR                | 2.071.359         | 2.086.396         | 0,78                         |
| Merck Financial Services GmbH 4,50% 10 - 24.03.20   | 3.034.000   | EUR                | 3.576.388         | 3.537.254         | 1,33                         |
| SAP SE 1,75% 14 - 22.02.27  | 375.000     | EUR                | 383.964           | 411.385           | 0,16                         |
| Vier Gas Transport GmbH 2,00% 13 - 12.06.20   | 300.000     | EUR                | 318.137           | 322.201           | 0,12                         |
| Volkswagen Leasing GmbH 2.625% 14 - 15.01.24  | 3.511.000   | EUR                | 3.709.279         | 3.864.457         | 1,45                         |
|   |             |                    | <b>38.454.304</b> | <b>39.258.148</b> | <b>14,76</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| GE Capital European Funding Unlimited Co.<br>4,25% 10 - 01.03.17                                  | 127.000     | EUR                | 135.943           | 130.649           | 0,05                         |
|   |             |                    | <b>135.943</b>    | <b>130.649</b>    | <b>0,05</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Assicurazioni Generali SpA 5.125% 09 -<br>16.09.24  | 3.000.000   | EUR                | 3.828.745         | 3.858.404         | 1,45                         |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,50%<br>12 - 20.03.17  | 1.500.000   | EUR                | 1.563.184         | 1.533.195         | 0,58                         |
| Enel SpA 5,25% 07 - 20.06.17  | 134.000     | EUR                | 150.625           | 140.775           | 0,05                         |
| Enel SpA 5,25% 04 - 20.05.24  | 300.000     | EUR                | 389.358           | 404.452           | 0,15                         |
| Eni SpA 3,25% 13 - 10.07.23   | 293.000     | EUR                | 337.501           | 344.277           | 0,13                         |
| Eni SpA 3,50% 10 - 29.01.18   | 1.194.000   | EUR                | 1.302.141         | 1.259.609         | 0,47                         |
| Eni SpA 4,25% 12 - 03.02.20   | 200.000     | EUR                | 232.334           | 228.439           | 0,09                         |
| Intesa Sanpaolo SpA 4,00% 12 - 09.11.17   | 164.000     | EUR                | 176.951           | 172.150           | 0,07                         |
| Intesa Sanpaolo SpA 6,625% 13 - 13.09.23  | 400.000     | EUR                | 494.000           | 464.148           | 0,17                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,15% 14 -<br>15.05.17  | 5.000.000   | EUR                | 5.057.120         | 5.058.450         | 1,90                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 -<br>01.08.18  | 1.500.000   | EUR                | 1.640.476         | 1.641.724         | 0,62                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 11 -<br>01.09.21  | 8.628.000   | EUR                | 10.631.163        | 10.550.777        | 3,97                         |
| Snam SpA 4,375% 12 - 11.07.16   | 81.000      | EUR                | 84.637            | 81.055            | 0,03                         |
| Telecom Italia SpA 4,50% 12 - 20.09.17  | 600.000     | EUR                | 642.750           | 629.238           | 0,24                         |
| Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 2,875% 12 -<br>16.02.18  | 4.000.000   | EUR                | 4.245.880         | 4.187.117         | 1,57                         |
| Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 4,75% 11 -<br>15.03.21   | 569.000     | EUR                | 689.673           | 687.441           | 0,26                         |
|   |             |                    | <b>31.466.538</b> | <b>31.241.251</b> | <b>11,75</b>                 |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Commerzbank Finance & Covered Bond SA<br>FRN 07 - 20.03.17  | 2.000.000   | USD                | 1.749.733         | 1.775.743         | 0,67                         |
| European Financial Stability Facility 3.875%<br>12 - 30.03.32                                     | 1.200.000   | EUR                | 1.746.150         | 1.797.837         | 0,67                         |
| Nestle Finance International Ltd. 1,75% 12 -<br>12.09.22  | 1.962.000   | EUR                | 2.124.217         | 2.159.779         | 0,81                         |
| Telecom Italia Finance SA 7,75% 03 - 24.01.33   | 37.000      | EUR                | 50.736            | 49.303            | 0,02                         |
|   |             |                    | <b>5.670.836</b>  | <b>5.782.662</b>  | <b>2,17</b>                  |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| ABN AMRO Bank NV 2,25% 11 - 10.07.18  | 2.510.000   | CHF                | 2.586.986         | 2.458.081         | 0,92                         |
| ABN AMRO Bank NV 2,50% 13 - 05.09.23  | 600.000     | EUR                | 689.274           | 705.641           | 0,27                         |
| ABN AMRO Bank NV 3,625% 10 - 06.10.17   | 252.000     | EUR                | 271.643           | 263.589           | 0,10                         |
| BAT Netherlands Finance BV 3.125% 14 -<br>06.03.29  | 685.000     | EUR                | 831.309           | 827.456           | 0,31                         |
| BMW Finance NV 2,375% 13 - 24.01.23   | 525.000     | EUR                | 568.050           | 593.014           | 0,22                         |
| BMW Finance NV 3.875% 10 - 18.01.17   | 10.000      | EUR                | 10.204            | 10.213            | 0,00                         |
| BMW Finance NV 5,00% 03 - 06.08.18  | 3.250.000   | EUR                | 3.768.193         | 3.594.751         | 1,35                         |
| Conti-Gummi Finance BV 2,50% 13 - 20.03.17  | 114.000     | EUR                | 118.383           | 116.035           | 0,04                         |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,125% 10 -<br>14.01.20  | 5.566.000   | EUR                | 6.503.378         | 6.342.146         | 2,39                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Niederlande (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,75% 08 - 15.01.18  | 1.250.000   | EUR                | 1.421.313         | 1.341.467         | 0,50                         |
| Deutsche Telekom International Finance BV 2,125% 13 - 18.01.21                                    | 2.046.000   | EUR                | 2.222.016         | 2.236.097         | 0,84                         |
| Deutsche Telekom International Finance BV 4,25% 10 - 16.03.20                                     | 3.000.000   | EUR                | 3.579.510         | 3.469.466         | 1,30                         |
| Deutsche Telekom International Finance BV 4,25% 10 - 13.07.22                                     | 300.000     | EUR                | 368.490           | 369.866           | 0,14                         |
| Deutsche Telekom International Finance BV 4,875% 10 - 22.04.25                                    | 500.000     | EUR                | 682.565           | 673.131           | 0,25                         |
| Deutsche Telekom International Finance BV 6,00% 09 - 20.01.17                                     | 600.000     | EUR                | 638.178           | 619.968           | 0,23                         |
| E.ON International Finance BV 5,50% 07 - 02.10.17   | 89.000      | EUR                | 99.749            | 95.122            | 0,04                         |
| E.ON International Finance BV 5,75% 08 - 07.05.20   | 1.950.000   | EUR                | 2.376.452         | 2.367.159         | 0,89                         |
| Enel Finance International NV 1,966% 15 - 27.01.25  | 1.930.000   | EUR                | 1.980.875         | 2.106.653         | 0,79                         |
| Enel Finance International NV 4,875% 12 - 17.04.23  | 293.000     | EUR                | 368.128           | 377.234           | 0,14                         |
| Enel Finance International NV 5,00% 09 - 14.09.22   | 1.623.000   | EUR                | 2.040.750         | 2.066.877         | 0,78                         |
| Heineken NV 2,125% 12 - 04.08.20  | 1.043.000   | EUR                | 1.128.745         | 1.121.764         | 0,42                         |
| Heineken NV 2,50% 12 - 19.03.19   | 1.357.000   | EUR                | 1.450.347         | 1.445.436         | 0,54                         |
| ING Bank NV 3,375% 12 - 10.01.22  | 600.000     | EUR                | 724.860           | 716.630           | 0,27                         |
| ING Bank NV 4,25% 12 - 13.01.17   | 120.000     | EUR                | 127.844           | 122.701           | 0,05                         |
| ING Groep NV 4,75% 07 - 31.05.17  | 149.000     | EUR                | 162.240           | 155.490           | 0,06                         |
| Koninklijke KPN NV 7,50% 09 - 04.02.19  | 1.773.000   | EUR                | 2.257.331         | 2.109.665         | 0,79                         |
| Linde Finance BV 3,125% 11 - 12.12.18   | 1.107.000   | EUR                | 1.206.686         | 1.193.974         | 0,45                         |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.23   | 2.228.000   | EUR                | 2.226.380         | 2.261.955         | 0,85                         |
| Netherlands Zero Coupon – 05 - 15.01.29   | 1.100.000   | EUR                | 1.036.513         | 1.053.833         | 0,40                         |
| Roche Finance Europe BV 2,00% 12 - 25.06.18   | 2.849.000   | EUR                | 2.987.356         | 2.967.261         | 1,12                         |
| RWE Finance BV 3,00% 13 - 17.01.24  | 1.165.000   | EUR                | 1.293.418         | 1.321.645         | 0,50                         |
| RWE Finance BV 6,50% 09 - 10.08.21  | 600.000     | EUR                | 754.980           | 767.587           | 0,29                         |
| Shell International Finance BV 4,375% 09 - 14.05.18   | 443.000     | EUR                | 517.265           | 480.137           | 0,18                         |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV 1,50% 12 - 10.03.20  | 1.000.000   | EUR                | 1.060.300         | 1.058.957         | 0,40                         |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV 1,75% 13 - 12.03.21  | 2.039.000   | EUR                | 2.195.059         | 2.209.744         | 0,83                         |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV 5,625% 08 - 11.06.18   | 1.359.000   | EUR                | 1.660.888         | 1.512.494         | 0,57                         |
| Volkswagen International Finance NV 1,875% 12 - 15.05.17  | 596.000     | EUR                | 619.131           | 605.232           | 0,23                         |
| Volkswagen International Finance NV 3,25% 12 - 21.01.19   | 503.000     | EUR                | 547.646           | 540.903           | 0,20                         |
|   |             |                    | <b>53.082.435</b> | <b>52.279.374</b> | <b>19,65</b>                 |
| <b>Norwegen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| DNB Boligkreditt AS 1,875% 12 - 18.06.19  | 600.000     | EUR                | 641.118           | 636.808           | 0,24                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Norwegen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| DNB Boligkreditt AS 2.375% 12 - 11.04.17  | 450.000     | EUR                | 473.189           | 458.973           | 0,17                         |
| DNB Boligkreditt AS 3.375% 07 - 16.11.16  | 7.220.000   | CHF                | 7.376.579         | 6.770.992         | 2,55                         |
|   |             |                    | <b>8.490.886</b>  | <b>7.866.773</b>  | <b>2,96</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Iberdrola Finanzas SAU 5.625% 08 - 09.05.18   | 300.000     | EUR                | 346.239           | 331.560           | 0,12                         |
| Spain 3,80% 14 - 30.04.24   | 4.743.000   | EUR                | 5.658.981         | 5.775.195         | 2,17                         |
| Spain 4,60% 09 - 30.07.19   | 6.744.000   | EUR                | 7.659.269         | 7.701.344         | 2,90                         |
| Spain 5,50% 02 - 30.07.17   | 6.826.000   | EUR                | 7.233.752         | 7.244.570         | 2,72                         |
| Telefonica Emisiones SAU 3.987% 13 - 23.01.23   | 400.000     | EUR                | 470.729           | 478.185           | 0,18                         |
|   |             |                    | <b>21.368.970</b> | <b>21.530.854</b> | <b>8,09</b>                  |
| <b>Schweden</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Nordea Bank AB 1,375% 13 - 12.04.18   | 156.000     | EUR                | 160.909           | 159.861           | 0,06                         |
| Nordea Bank AB 3,75% 10 - 24.02.17  | 127.000     | EUR                | 134.799           | 130.128           | 0,05                         |
| Nordea Bank AB 4,00% 10 - 29.06.20  | 110.000     | EUR                | 128.361           | 127.023           | 0,05                         |
| Nordea Bank AB 4,50% 10 - 26.03.20  | 1.100.000   | EUR                | 1.261.618         | 1.237.877         | 0,46                         |
| Stadshypotek AB 1,875% 12 - 21.03.17  | 400.000     | EUR                | 416.016           | 406.052           | 0,15                         |
| Svenska Handelsbanken AB 3,75% 10 - 24.02.17  | 110.000     | EUR                | 116.838           | 112.717           | 0,04                         |
| Swedbank AB 1,50% 14 - 18.03.19   | 300.000     | EUR                | 309.563           | 312.431           | 0,12                         |
| TeliaSonera AB 4,00% 11 - 22.03.22  | 3.000.000   | EUR                | 3.564.030         | 3.580.404         | 1,35                         |
| Vattenfall AB 6,25% 09 - 17.03.21   | 520.000     | EUR                | 686.348           | 657.460           | 0,25                         |
|   |             |                    | <b>6.778.482</b>  | <b>6.723.953</b>  | <b>2,53</b>                  |
| <b>Schweiz</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Credit Suisse AG 1,75% 14 - 15.01.21  | 600.000     | EUR                | 641.502           | 647.946           | 0,24                         |
|   |             |                    | <b>641.502</b>    | <b>647.946</b>    | <b>0,24</b>                  |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| AstraZeneca PLC 0,875% 14 - 24.11.21  | 3.900.000   | EUR                | 3.977.836         | 4.022.043         | 1,51                         |
| Bank of Scotland PLC 3.875% 05 - 07.02.20   | 400.000     | EUR                | 469.992           | 455.370           | 0,17                         |
| Barclays Bank PLC 2,25% 12 - 22.02.17   | 600.000     | EUR                | 630.126           | 608.874           | 0,23                         |
| Barclays Bank PLC 4,00% 10 - 20.01.17   | 170.000     | EUR                | 180.491           | 173.716           | 0,07                         |
| Barclays Bank PLC 4,00% 09 - 07.10.19   | 400.000     | EUR                | 469.192           | 452.419           | 0,17                         |
| Barclays Bank PLC 6,00% 08 - 23.01.18   | 149.000     | EUR                | 168.605           | 160.328           | 0,06                         |
| BAT International Finance PLC 3.625% 11 - 09.11.21  | 600.000     | EUR                | 673.782           | 696.086           | 0,26                         |
| HSBC Bank PLC 4,00% 10 - 15.01.21   | 127.000     | EUR                | 150.490           | 148.565           | 0,06                         |
| HSBC Holdings PLC 6,00% 09 - 10.06.19   | 1.515.000   | EUR                | 1.835.801         | 1.725.996         | 0,65                         |
| Lloyds Bank PLC 5.375% 09 - 03.09.19  | 105.000     | EUR                | 126.270           | 120.943           | 0,05                         |
| Lloyds Bank PLC 6,50% 10 - 24.03.20   | 200.000     | EUR                | 247.594           | 230.193           | 0,09                         |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 1,50% 13 - 28.11.16  | 300.000     | EUR                | 304.416           | 301.374           | 0,11                         |
| Standard Chartered PLC 3,625% 12 - 23.11.22   | 1.000.000   | EUR                | 1.062.960         | 993.981           | 0,37                         |
| United Kingdom Gilt 2,50% 15 - 22.07.65   | 7.500.000   | GBP                | 12.084.414        | 12.056.206        | 4,53                         |
| Vodafone Group PLC 1,875% 14 - 11.09.25   | 750.000     | EUR                | 796.815           | 788.633           | 0,30                         |
| Vodafone Group PLC 5.375% 07 - 06.06.22   | 1.400.000   | EUR                | 1.705.648         | 1.763.847         | 0,66                         |
|   |             |                    | <b>24.884.432</b> | <b>24.698.574</b> | <b>9,29</b>                  |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Bank of America Corp.   | 149.000     | EUR                | 160.555           | 161.572           | 0,06                         |
| Citigroup Inc. 1,375% 14 - 27.10.21   | 600.000     | EUR                | 605.395           | 623.635           | 0,23                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Citigroup Inc. 5,00% 04 - 02.08.19  | 787.000     | EUR                | 916.816            | 899.881            | 0,34                         |
| Citigroup Inc. 7.375% 09 - 04.09.19   | 1.549.000   | EUR                | 2.060.148          | 1.892.866          | 0,71                         |
| General Electric Co. 1,25% 15 - 26.05.23  | 1.000.000   | EUR                | 1.007.027          | 1.055.236          | 0,40                         |
| General Electric Co. 1,875% 15 - 28.05.27   | 1.000.000   | EUR                | 1.027.671          | 1.100.890          | 0,41                         |
| Goldman Sachs Group Inc. 2,50% 14 - 18.10.21  | 2.490.000   | EUR                | 2.577.175          | 2.701.623          | 1,02                         |
| Goldman Sachs Group Inc. 2,625% 13 - 19.08.20   | 125.000     | EUR                | 135.406            | 135.009            | 0,05                         |
| International Business Machines Corp.   | 500.000     | EUR                | 526.861            | 538.973            | 0,20                         |
| JPMorgan Chase & Co. 2.625% 13 - 23.04.21   | 150.000     | EUR                | 164.611            | 165.586            | 0,06                         |
| Morgan Stanley 2.375% 14 - 31.03.21   | 155.000     | EUR                | 165.944            | 167.324            | 0,06                         |
| Procter & Gamble Co. 2,00% 12 - 16.08.22  | 500.000     | EUR                | 550.990            | 554.885            | 0,21                         |
| Procter & Gamble Co. 4,875% 07 - 11.05.27   | 450.000     | EUR                | 608.296            | 642.325            | 0,24                         |
| Toyota Motor Credit Corp. 1,25% 13 - 01.08.17   | 100.000     | EUR                | 102.024            | 101.434            | 0,04                         |
| Toyota Motor Credit Corp. 1,80% 13 - 23.07.20   | 1.112.000   | EUR                | 1.191.753          | 1.188.061          | 0,45                         |
| Wal-Mart Stores Inc. 1,90% 14 - 08.04.22  | 1.327.000   | EUR                | 1.392.355          | 1.452.497          | 0,55                         |
| Wells Fargo & Co. 4.125% 06 - 03.11.16  | 264.000     | EUR                | 278.779            | 267.616            | 0,10                         |
|   |             |                    | <b>13.471.806</b>  | <b>13.649.413</b>  | <b>5,13</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>263.002.523</b> | <b>261.684.437</b> | <b>98,38</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>263.002.523</b> | <b>261.684.437</b> | <b>98,38</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| BNP Paribas SA 5,00% 11 - 15.01.21  | 508.000     | USD                | 529.962            | 512.390            | 0,19                         |
|   |             |                    | <b>529.962</b>     | <b>512.390</b>     | <b>0,19</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>529.962</b>     | <b>512.390</b>     | <b>0,19</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>529.962</b>     | <b>512.390</b>     | <b>0,19</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>263.532.485</b> | <b>262.196.827</b> | <b>98,57</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>265.739.593</b> | <b>99,90</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Bundesrepublik Deutschland 1,00% 15 - 15.08.25  | 7.472.000   | EUR                | 7.774.949         | 8.298.071         | 9,21                      |
| Bundesrepublik Deutschland 1,75% 14 - 15.02.24  | 1.351.000   | EUR                | 1.541.181         | 1.574.082         | 1,75                      |
| Bundesrepublik Deutschland 3,25% 09 - 04.01.20  | 552.000     | EUR                | 624.546           | 628.401           | 0,70                      |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.39  | 6.400.000   | EUR                | 10.769.109        | 12.126.644        | 13,47                     |
| Bundesrepublik Deutschland 5,50% 00 - 04.01.31  | 4.154.000   | EUR                | 6.823.776         | 7.464.697         | 8,29                      |
| Bundesrepublik Deutschland 5,625% 98 - 04.01.28   | 8.136.000   | EUR                | 13.034.249        | 13.587.367        | 15,09                     |
| Bundesrepublik Deutschland 6,25% 94 - 04.01.24  | 5.778.000   | EUR                | 8.462.054         | 8.710.816         | 9,67                      |
| Bundesrepublik Deutschland 6,50% 97 - 04.07.27  | 11.184.000  | EUR                | 18.408.352        | 19.472.538        | 21,62                     |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 - 15.09.17   | 3.400.000   | EUR                | 3.421.350         | 3.426.641         | 3,81                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.16   | 1.928.000   | EUR                | 1.926.678         | 1.928.000         | 2,14                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.18   | 5.578.000   | EUR                | 5.545.711         | 5.639.414         | 6,26                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.01.19   | 2.286.000   | EUR                | 2.278.876         | 2.314.575         | 2,57                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.21   | 1.284.000   | EUR                | 1.297.211         | 1.310.245         | 1,45                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.22   | 1.188.000   | EUR                | 1.199.129         | 1.216.952         | 1,35                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.23   | 1.788.000   | EUR                | 1.772.382         | 1.791.183         | 1,99                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.24   | 1.187.000   | EUR                | 1.172.200         | 1.186.335         | 1,32                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.25   | 1.187.000   | EUR                | 1.157.792         | 1.190.632         | 1,32                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.26   | 1.188.000   | EUR                | 1.142.898         | 1.187.739         | 1,32                      |
|   |             |                    | <b>88.352.443</b> | <b>93.054.332</b> | <b>103,33</b>             |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>88.352.443</b> | <b>93.054.332</b> | <b>103,33</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>88.352.443</b> | <b>93.054.332</b> | <b>103,33</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>88.352.443</b> | <b>93.054.332</b> | <b>103,33</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>94.646.375</b> | <b>105,09</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GERMANY 1-3 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesobligation Zero Coupon – 16 - 09.04.21  | 477.000     | EUR                | 484.445           | 489.909           | 0,89                         |
| Bundesobligation 0,25% 14 - 11.10.19  | 2.600.000   | EUR                | 2.664.945         | 2.677.512         | 4,88                         |
| Bundesobligation 0,50% 12 - 13.10.17  | 2.105.000   | EUR                | 2.132.140         | 2.135.868         | 3,89                         |
| Bundesobligation 0,50% 13 - 23.02.18  | 2.187.000   | EUR                | 2.223.240         | 2.228.701         | 4,06                         |
| Bundesobligation 0,50% 14 - 12.04.19  | 5.979.000   | EUR                | 6.138.508         | 6.172.501         | 11,25                        |
| Bundesobligation 1,00% 14 - 22.02.19  | 806.000     | EUR                | 838.148           | 841.593           | 1,53                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 12 - 04.09.22  | 204.000     | EUR                | 225.760           | 229.440           | 0,42                         |
| Bundesrepublik Deutschland 1,75% 12 - 04.07.22  | 383.000     | EUR                | 428.876           | 435.654           | 0,79                         |
| Bundesrepublik Deutschland 2,00% 11 - 04.01.22  | 2.544.000   | EUR                | 2.880.119         | 2.905.121         | 5,30                         |
| Bundesrepublik Deutschland 2,25% 10 - 04.09.20  | 587.000     | EUR                | 652.980           | 658.807           | 1,20                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,50% 09 - 04.07.19  | 8.672.000   | EUR                | 9.866.200         | 9.761.439         | 17,79                        |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 07 - 04.01.18  | 2.236.000   | EUR                | 2.389.586         | 2.394.490         | 4,37                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.17  | 2.707.000   | EUR                | 2.901.038         | 2.840.352         | 5,18                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 - 10.03.17   | 206.000     | EUR                | 206.719           | 206.906           | 0,38                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 - 15.12.17   | 1.696.000   | EUR                | 1.708.378         | 1.712.094         | 3,12                         |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 16 - 16.03.18   | 1.051.000   | EUR                | 1.060.098         | 1.062.824         | 1,94                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.01.18   | 4.873.000   | EUR                | 4.852.413         | 4.911.497         | 8,95                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.01.19   | 2.531.000   | EUR                | 2.528.087         | 2.562.637         | 4,67                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.01.20   | 4.808.000   | EUR                | 4.779.788         | 4.891.803         | 8,92                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 10 - 04.07.20   | 100.000     | EUR                | 101.608           | 102.409           | 0,19                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.01.21   | 5.559.000   | EUR                | 5.571.993         | 5.669.290         | 10,34                        |
|   |             |                    | <b>54.635.069</b> | <b>54.890.847</b> | <b>100,06</b>                |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>54.635.069</b> | <b>54.890.847</b> | <b>100,06</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>54.635.069</b> | <b>54.890.847</b> | <b>100,06</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>54.635.069</b> | <b>54.890.847</b> | <b>100,06</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>55.420.129</b> | <b>101,03</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF KOREA GOVERNMENT UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Singapur</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Singapore 0,50% 13 - 01.04.18   | 4.500.000   | SGD                | 3.362.399         | 3.302.422         | 18,37                        |
| Singapore 1,625% 14 - 01.10.19  | 6.000.000   | SGD                | 4.476.180         | 4.502.778         | 25,05                        |
| Singapore 2,00% 15 - 01.07.20   | 5.900.000   | SGD                | 4.435.725         | 4.485.853         | 24,95                        |
| Singapore 2,375% 10 - 01.04.17  | 4.200.000   | SGD                | 3.195.690         | 3.148.522         | 17,52                        |
| Singapore 2,50% 09 - 01.06.19   | 2.800.000   | SGD                | 2.166.873         | 2.152.107         | 11,97                        |
| Singapore 3,75% 01 - 01.09.16   | 1.000.000   | SGD                | 818.491           | 744.612           | 4,14                         |
|   |             |                    | <b>18.455.358</b> | <b>18.336.294</b> | <b>102,00</b>                |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>18.455.358</b> | <b>18.336.294</b> | <b>102,00</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>18.455.358</b> | <b>18.336.294</b> | <b>102,00</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>18.455.358</b> | <b>18.336.294</b> | <b>102,00</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>18.433.922</b> | <b>102,54</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 2,00%<br>13 - 19.09.19                                      | 300.000     | EUR                | 318.786          | 317.894          | 2,10                         |
| Cie de Financement Foncier SA 2,00% 10 -<br>20.12.17  | 1.000.000   | CHF                | 942.683          | 958.877          | 6,32                         |
| France OAT 2,25% 12 - 25.10.22  | 1.400.000   | EUR                | 1.595.331        | 1.620.766        | 10,68                        |
| HSBC France SA 1.875% 13 - 16.01.20   | 400.000     | EUR                | 426.104          | 422.798          | 2,79                         |
|   |             |                    | <b>3.282.904</b> | <b>3.320.335</b> | <b>21,89</b>                 |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,50%<br>12 - 20.03.17  | 200.000     | EUR                | 210.436          | 204.426          | 1,35                         |
| Intesa Sanpaolo SpA 4,375% 12 - 15.10.19  | 300.000     | EUR                | 341.970          | 334.812          | 2,21                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 -<br>01.03.19  | 950.000     | EUR                | 1.079.609        | 1.064.292        | 7,02                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 04 -<br>01.02.20  | 600.000     | EUR                | 692.103          | 694.644          | 4,58                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 -<br>01.11.27  | 700.000     | EUR                | 1.062.394        | 1.063.825        | 7,01                         |
| Snam SpA 4,375% 12 - 11.07.16   | 166.000     | EUR                | 175.465          | 166.113          | 1,09                         |
|   |             |                    | <b>3.561.977</b> | <b>3.528.112</b> | <b>23,26</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| ABN AMRO Bank NV 2,25% 11 - 10.07.18  | 770.000     | CHF                | 794.342          | 754.073          | 4,97                         |
|   |             |                    | <b>794.342</b>   | <b>754.073</b>   | <b>4,97</b>                  |
| <b>Norwegen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| DNB Boligkreditt AS 3.375% 07 - 16.11.16  | 780.000     | CHF                | 797.063          | 731.492          | 4,82                         |
|   |             |                    | <b>797.063</b>   | <b>731.492</b>   | <b>4,82</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 1.000.000   | EUR                | 1.082.049        | 1.088.120        | 7,17                         |
| Spain 5,75% 01 - 30.07.32   | 400.000     | EUR                | 596.661          | 629.826          | 4,15                         |
| Spain 5,85% 11 - 31.01.22   | 1.250.000   | EUR                | 1.600.813        | 1.631.848        | 10,76                        |
|   |             |                    | <b>3.279.523</b> | <b>3.349.794</b> | <b>22,08</b>                 |
| <b>Schweden</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Nordea Bank AB 4,50% 10 - 26.03.20  | 700.000     | EUR                | 803.773          | 787.740          | 5,19                         |
|   |             |                    | <b>803.773</b>   | <b>787.740</b>   | <b>5,19</b>                  |
| <b>Schweiz</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Credit Suisse AG 3,875% 10 - 25.01.17   | 191.000     | EUR                | 202.460          | 195.128          | 1,29                         |
|   |             |                    | <b>202.460</b>   | <b>195.128</b>   | <b>1,29</b>                  |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Barclays Bank PLC 6,625% 11 - 30.03.22  | 100.000     | EUR                | 125.718          | 117.697          | 0,78                         |
| Standard Chartered PLC 1.625% 13 - 20.11.18   | 365.000     | EUR                | 379.359          | 373.485          | 2,46                         |
|   |             |                    | <b>505.077</b>   | <b>491.182</b>   | <b>3,24</b>                  |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Citigroup Inc. 2,375% 14 - 22.05.24   | 500.000     | EUR                | 523.160          | 545.257          | 3,59                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>                 |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Goldman Sachs Group Inc. 2,00% 15 -<br>27.07.23   | 500.000     | EUR                | 509.090           | 526.219           | 3,47                         |
|   |             |                    | <b>1.032.250</b>  | <b>1.071.476</b>  | <b>7,06</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>14.259.369</b> | <b>14.229.332</b> | <b>93,80</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>14.259.369</b> | <b>14.229.332</b> | <b>93,80</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>             |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| BNP Paribas SA 5,00% 11 - 15.01.21  | 391.000     | USD                | 394.843           | 394.379           | 2,60                         |
|   |             |                    | <b>394.843</b>    | <b>394.379</b>    | <b>2,60</b>                  |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,50% 11 -<br>11.01.21   | 461.000     | USD                | 442.512           | 460.341           | 3,04                         |
|   |             |                    | <b>442.512</b>    | <b>460.341</b>    | <b>3,04</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>837.355</b>    | <b>854.720</b>    | <b>5,64</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare<br/>Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>837.355</b>    | <b>854.720</b>    | <b>5,64</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>15.096.724</b> | <b>15.084.052</b> | <b>99,44</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>15.339.261</b> | <b>101,12</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Telekom Finanzmanagement GmbH 3.125% 13 - 03.12.21  | 109.000     | EUR                | 120.479           | 124.344           | 0,22                      |
|   |             |                    | <b>120.479</b>    | <b>124.344</b>    | <b>0,22</b>               |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV 2,25% 13 - 24.09.20  | 200.000     | EUR                | 214.317           | 217.657           | 0,38                      |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV 6,50% 09 - 23.06.17  | 1.500.000   | GBP                | 2.236.158         | 1.897.209         | 3,28                      |
|   |             |                    | <b>2.450.475</b>  | <b>2.114.866</b>  | <b>3,66</b>               |
| <b>Cayman-Inseln</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Hutchison Whampoa Finance 06 Ltd. 4.625% 06 - 21.09.16  | 1.000.000   | EUR                | 1.069.170         | 1.009.790         | 1,75                      |
|   |             |                    | <b>1.069.170</b>  | <b>1.009.790</b>  | <b>1,75</b>               |
| <b>Dänemark</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Carlsberg Breweries A/S 2.625% 12 - 03.07.19  | 200.000     | EUR                | 214.742           | 214.495           | 0,37                      |
| Carlsberg Breweries A/S 3,375% 10 - 13.10.17  | 195.000     | EUR                | 208.395           | 203.211           | 0,35                      |
|   |             |                    | <b>423.137</b>    | <b>417.706</b>    | <b>0,72</b>               |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Bouygues SA 4,50% 12 - 09.02.22   | 200.000     | EUR                | 243.608           | 245.040           | 0,42                      |
| Casino Guichard Perrachon SA 4.379% 10 - 08.02.17   | 100.000     | EUR                | 102.308           | 102.140           | 0,18                      |
| Cie de Financement Foncier SA 2,00% 10 - 20.12.17   | 3.000.000   | CHF                | 2.853.164         | 2.876.631         | 4,98                      |
| Cie de Saint-Gobain 4,75% 07 - 11.04.17   | 50.000      | EUR                | 53.782            | 51.829            | 0,09                      |
| Electricite de France SA 3,875% 12 - 18.01.22   | 100.000     | EUR                | 115.595           | 118.878           | 0,21                      |
| Engie SA 3,00% 12 - 01.02.23  | 170.000     | EUR                | 195.333           | 198.839           | 0,34                      |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 2.500.000   | EUR                | 3.870.585         | 4.124.992         | 7,14                      |
| Orange SA 3,875% 10 - 09.04.20  | 100.000     | EUR                | 112.166           | 114.163           | 0,20                      |
| Orange SA 4,75% 07 - 21.02.17   | 71.000      | EUR                | 76.079            | 73.154            | 0,13                      |
| Orange SA 5.625% 08 - 22.05.18  | 3.907.000   | EUR                | 4.363.474         | 4.324.863         | 7,49                      |
| RTE Reseau de Transport d'Electricite SA 2.875% 13 - 12.09.23                                     | 300.000     | EUR                | 338.745           | 351.163           | 0,61                      |
| Sanofi 1,00% 12 - 14.11.17  | 350.000     | EUR                | 354.883           | 355.224           | 0,62                      |
| Sanofi 2,50% 13 - 14.11.23  | 300.000     | EUR                | 333.315           | 345.904           | 0,60                      |
| Transport et Infrastructures Gaz France SA 4.339% 11 - 07.07.21                                   | 100.000     | EUR                | 114.663           | 118.003           | 0,20                      |
|   |             |                    | <b>13.127.700</b> | <b>13.400.823</b> | <b>23,21</b>              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Daimler AG 1,50% 13 - 19.11.18  | 293.000     | EUR                | 305.045           | 303.785           | 0,53                      |
| SAP SE 1,75% 14 - 22.02.27  | 600.000     | EUR                | 590.478           | 658.216           | 1,14                      |
|   |             |                    | <b>895.523</b>    | <b>962.001</b>    | <b>1,67</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Enel SpA 5,25% 07 - 20.06.17  | 109.000     | EUR                | 120.279           | 114.511           | 0,20                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 09 - 01.09.40   | 2.092.000   | EUR                | 3.027.649         | 3.176.493         | 5,50                      |
| Snam SpA 4,375% 12 - 11.07.16   | 62.000      | EUR                | 64.542            | 62.042            | 0,11                      |
| Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 4,75% 11 - 15.03.21  | 1.172.000   | EUR                | 1.449.014         | 1.415.959         | 2,45                      |
|   |             |                    | <b>4.661.484</b>  | <b>4.769.005</b>  | <b>8,26</b>               |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Japan Government Forty Year Bond 0,40% 16 - 07.06.32  | 170.000.000 | JPY                | 1.395.073         | 1.637.005         | 2,84                      |
| Japan Government Ten Year Bond 1,70% 06 - 20.09.16  | 200.000.000 | JPY                | 1.604.222         | 1.761.972         | 3,05                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,80% 13 - 20.03.56   | 130.000.000 | JPY                | 1.470.934         | 1.651.219         | 2,86                      |
|   |             |                    | <b>4.470.229</b>  | <b>5.050.196</b>  | <b>8,75</b>               |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Nestle Finance International Ltd. 1,75% 12 - 12.09.22   | 100.000     | EUR                | 106.441           | 110.080           | 0,19                      |
|   |             |                    | <b>106.441</b>    | <b>110.080</b>    | <b>0,19</b>               |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| BMW Finance NV 2,375% 13 - 24.01.23   | 225.000     | EUR                | 247.943           | 254.149           | 0,44                      |
| BMW Finance NV 3,875% 10 - 18.01.17   | 347.000     | EUR                | 359.228           | 354.405           | 0,61                      |
| BMW Finance NV 5,00% 03 - 06.08.18  | 500.000     | EUR                | 547.923           | 553.039           | 0,96                      |
| Deutsche Telekom International Finance BV 6,00% 09 - 20.01.17                                     | 1.374.000   | EUR                | 1.522.319         | 1.419.727         | 2,46                      |
| E.ON International Finance BV 5,75% 08 - 07.05.20   | 1.050.000   | EUR                | 1.275.112         | 1.274.624         | 2,21                      |
| Enbw International Finance BV 4,875% 04 - 16.01.25  | 100.000     | EUR                | 125.529           | 134.268           | 0,23                      |
| Iberdrola International BV 4,50% 12 - 21.09.17  | 100.000     | EUR                | 105.180           | 105.458           | 0,18                      |
| Koninklijke KPN NV 3,75% 10 - 21.09.20  | 872.000     | EUR                | 1.015.392         | 998.334           | 1,73                      |
| Linde Finance BV 3,125% 11 - 12.12.18   | 1.093.000   | EUR                | 1.209.671         | 1.178.874         | 2,04                      |
| Roche Finance Europe BV 2,00% 12 - 25.06.18   | 350.000     | EUR                | 364.377           | 364.528           | 0,63                      |
| RWE Finance BV 3,00% 13 - 17.01.24  | 455.000     | EUR                | 512.917           | 516.179           | 0,90                      |
| Shell International Finance BV 1,625% 14 - 24.03.21   | 293.000     | EUR                | 308.066           | 314.665           | 0,55                      |
| Shell International Finance BV 4,375% 09 - 14.05.18   | 250.000     | EUR                | 279.028           | 270.958           | 0,47                      |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV 5,125% 09 - 20.02.17   | 74.000      | EUR                | 79.911            | 76.462            | 0,13                      |
|   |             |                    | <b>7.952.596</b>  | <b>7.815.670</b>  | <b>13,54</b>              |
| <b>Norwegen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Statoil ASA 5,625% 09 - 11.03.21  | 250.000     | EUR                | 320.710           | 312.695           | 0,54                      |
| Telenor ASA 2,50% 13 - 22.05.25   | 100.000     | EUR                | 107.437           | 113.766           | 0,20                      |
|   |             |                    | <b>428.147</b>    | <b>426.461</b>    | <b>0,74</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Gas Natural Capital Markets SA 4,125% 10 - 26.01.18   | 100.000     | EUR                | 105.775           | 106.354           | 0,18                      |
| Gas Natural Capital Markets SA 6,00% 12 - 27.01.20  | 200.000     | EUR                | 242.806           | 240.661           | 0,42                      |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 3.400.000   | EUR                | 3.685.863         | 3.699.609         | 6,41                      |
| Spain 5,50% 11 - 30.04.21   | 9.519.000   | EUR                | 11.789.591        | 11.952.768        | 20,70                     |
|   |             |                    | <b>15.824.035</b> | <b>15.999.392</b> | <b>27,71</b>              |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| BAT International Finance PLC 5,375% 07 - 29.06.17  | 50.000      | EUR                | 54.936            | 52.651            | 0,09                      |
| BP Capital Markets PLC 2,994% 12 - 18.02.19   | 300.000     | EUR                | 321.333           | 322.888           | 0,56                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| BP Capital Markets PLC 3,83% 10 - 06.10.17  | 191.000     | EUR                | 208.561           | 200.180           | 0,35                      |
| GlaxoSmithKline Capital PLC 5.625% 07 - 13.12.17  | 50.000      | EUR                | 56.439            | 54.160            | 0,09                      |
| Vodafone Group PLC 4,65% 10 - 20.01.22  | 250.000     | EUR                | 301.700           | 302.113           | 0,52                      |
|   |             |                    | <b>942.969</b>    | <b>931.992</b>    | <b>1,61</b>               |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Apple Inc. 1,00% 14 - 10.11.22  | 100.000     | EUR                | 100.738           | 104.277           | 0,18                      |
| General Electric Co. 4,125% 12 - 09.10.42   | 510.000     | USD                | 503.382           | 504.940           | 0,87                      |
| Procter & Gamble Co. 5.125% 07 - 24.10.17   | 50.000      | EUR                | 55.629            | 53.477            | 0,09                      |
| SES GLOBAL Americas Holdings GP 1.875% 13 - 24.10.18  | 100.000     | EUR                | 103.001           | 103.891           | 0,18                      |
| Toyota Motor Credit Corp. 1,80% 13 - 23.07.20   | 1.388.000   | EUR                | 1.481.001         | 1.482.939         | 2,57                      |
| Wal-Mart Stores Inc. 1,90% 14 - 08.04.22  | 1.358.000   | EUR                | 1.477.667         | 1.486.429         | 2,58                      |
|   |             |                    | <b>3.721.418</b>  | <b>3.735.953</b>  | <b>6,47</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>56.193.803</b> | <b>56.868.279</b> | <b>98,50</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>56.193.803</b> | <b>56.868.279</b> | <b>98,50</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>56.193.803</b> | <b>56.868.279</b> | <b>98,50</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>57.527.870</b> | <b>99,64</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Bundesobligation 0,25% 13 - 13.04.18  | 2.374.000   | EUR                | 2.406.550         | 2.412.506         | 1,20                      |
| Bundesrepublik Deutschland 0,50% 16 - 15.02.26  | 4.300.000   | EUR                | 4.560.451         | 4.563.654         | 2,27                      |
| Bundesrepublik Deutschland 1,00% 15 - 15.08.25  | 20.900.000  | EUR                | 22.466.818        | 23.210.610        | 11,53                     |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 13 - 15.05.23  | 400.000     | EUR                | 452.214           | 454.237           | 0,22                      |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 14 - 15.05.24  | 400.000     | EUR                | 456.353           | 458.516           | 0,23                      |
| Bundesrepublik Deutschland 2,00% 13 - 15.08.23  | 400.000     | EUR                | 468.309           | 470.387           | 0,23                      |
| Bundesrepublik Deutschland 2,25% 11 - 20.09.43  | 700.000     | EUR                | 802.052           | 803.423           | 0,40                      |
| Bundesrepublik Deutschland 3,25% 11 - 04.07.21  | 400.000     | EUR                | 476.894           | 477.653           | 0,24                      |
| Bundesrepublik Deutschland 4,25% 07 - 04.07.39  | 9.285.000   | EUR                | 15.262.713        | 17.593.108        | 8,74                      |
| Bundesrepublik Deutschland 5,625% 98 - 04.01.28   | 12.700.000  | EUR                | 19.974.576        | 21.209.385        | 10,53                     |
| Bundesrepublik Deutschland 6,25% 94 - 04.01.24  | 700.000     | EUR                | 1.048.019         | 1.055.308         | 0,52                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.01.21   | 2.225.000   | EUR                | 2.231.660         | 2.269.144         | 1,13                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.01.23   | 669.000     | EUR                | 661.664           | 682.012           | 0,34                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.23   | 7.853.000   | EUR                | 7.778.254         | 7.866.978         | 3,91                      |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10% 12 - 15.04.23                                 | 3.445.151   | EUR                | 3.775.780         | 3.713.701         | 1,84                      |
| Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,50% 14 - 15.04.30                                 | 256.443     | EUR                | 279.665           | 309.502           | 0,15                      |
|   |             |                    | <b>83.101.972</b> | <b>87.550.124</b> | <b>43,48</b>              |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Luxembourg 2.125% 13 - 10.07.23   | 597.000     | EUR                | 680.085           | 699.259           | 0,34                      |
|   |             |                    | <b>680.085</b>    | <b>699.259</b>    | <b>0,34</b>               |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Netherlands Zero Coupon – 15 - 15.04.18   | 36.700.000  | EUR                | 36.944.503        | 37.089.571        | 18,42                     |
| Netherlands Zero Coupon – 98 - 15.01.27   | 1.704.000   | EUR                | 1.464.208         | 1.660.735         | 0,82                      |
| Netherlands 0,25% 14 - 15.01.20   | 500.000     | EUR                | 512.054           | 514.502           | 0,26                      |
| Netherlands 1,75% 13 - 15.07.23   | 23.210.000  | EUR                | 25.712.343        | 26.548.120        | 13,18                     |
| Netherlands 3,50% 10 - 15.07.20   | 16.511.000  | EUR                | 19.286.257        | 19.242.601        | 9,56                      |
| Netherlands 4,00% 09 - 15.07.19   | 11.201.000  | EUR                | 12.900.452        | 12.768.729        | 6,34                      |
| Netherlands 5,50% 98 - 15.01.28   | 4.700.000   | EUR                | 7.404.961         | 7.630.623         | 3,79                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Niederlande (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Netherlands 7,50% 93 - 15.01.23   | 3.575.000   | EUR                | 5.486.874          | 5.430.503          | 2,70                      |
|   |             |                    | <b>109.711.652</b> | <b>110.885.384</b> | <b>55,07</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>193.493.709</b> | <b>199.134.767</b> | <b>98,89</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>193.493.709</b> | <b>199.134.767</b> | <b>98,89</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>193.493.709</b> | <b>199.134.767</b> | <b>98,89</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>201.775.392</b> | <b>100,21</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Belgium Zero Coupon – 02 - 28.09.17   | 347.000     | EUR                | 345.229            | 349.453            | 0,02                         |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.18   | 1.097.000   | EUR                | 1.102.935          | 1.108.014          | 0,06                         |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.20   | 3.300.000   | EUR                | 3.237.477          | 3.350.820          | 0,18                         |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.21   | 958.000     | EUR                | 947.639            | 972.169            | 0,05                         |
| Belgium Zero Coupon – 11 - 28.09.21   | 728.000     | EUR                | 715.923            | 741.366            | 0,04                         |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.22   | 2.120.000   | EUR                | 2.119.780          | 2.161.510          | 0,12                         |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.23   | 500.000     | EUR                | 496.934            | 504.555            | 0,03                         |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.24   | 500.000     | EUR                | 492.310            | 498.940            | 0,03                         |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.25   | 1.088.000   | EUR                | 976.362            | 1.075.847          | 0,06                         |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.27   | 1.118.000   | EUR                | 1.018.549          | 1.077.450          | 0,06                         |
| Belgium Zero Coupon – 02 - 01.05.29   | 500.000     | EUR                | 500.636            | 500.740            | 0,03                         |
| Belgium 1,00% 16 - 22.06.26   | 3.397.000   | EUR                | 3.570.391          | 3.652.726          | 0,20                         |
| Belgium 1,00% 15 - 22.06.31   | 400.000     | EUR                | 410.481            | 425.553            | 0,02                         |
| Belgium 1,60% 16 - 22.06.47   | 50.000.000  | EUR                | 50.214.089         | 57.490.000         | 3,14                         |
| Belgium 2,60% 14 - 22.06.24   | 43.138.000  | EUR                | 49.958.898         | 52.304.247         | 2,85                         |
| Belgium 3,00% 12 - 28.09.19   | 49.900.000  | EUR                | 55.235.453         | 55.683.280         | 3,04                         |
| Belgium 3,50% 11 - 28.06.17   | 23.754.000  | EUR                | 25.413.065         | 24.702.015         | 1,35                         |
| Belgium 3,75% 13 - 22.06.45   | 1.007.000   | EUR                | 1.395.812          | 1.729.538          | 0,09                         |
| Belgium 4,00% 12 - 28.03.32   | 1.260.140   | EUR                | 1.547.132          | 1.921.512          | 0,11                         |
| Belgium 4,25% 12 - 28.09.22   | 17.780.000  | EUR                | 22.447.510         | 22.894.506         | 1,25                         |
| Belgium 4,25% 10 - 28.03.41   | 17.156.000  | EUR                | 26.704.462         | 30.324.002         | 1,65                         |
| Belgium 4,50% 11 - 28.03.26   | 238.000     | EUR                | 322.928            | 339.551            | 0,02                         |
| Belgium 5,00% 04 - 28.03.35   | 23.365.000  | EUR                | 37.665.867         | 41.366.681         | 2,26                         |
| Belgium 5,50% 98 - 28.03.28   | 18.316.000  | EUR                | 25.085.158         | 29.328.006         | 1,60                         |
|   |             |                    | <b>311.925.020</b> | <b>334.502.481</b> | <b>18,26</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Ireland 2,00% 15 - 18.02.45   | 25.749.000  | EUR                | 24.365.137         | 30.317.532         | 1,65                         |
| Ireland 4,50% 04 - 18.04.20   | 909.000     | EUR                | 975.784            | 1.072.287          | 0,06                         |
| Ireland 5,40% 09 - 13.03.25   | 46.182.000  | EUR                | 59.821.609         | 65.454.335         | 3,57                         |
| Ireland 5,90% 09 - 18.10.19   | 1.936.000   | EUR                | 2.313.410          | 2.328.352          | 0,13                         |
|   |             |                    | <b>87.475.940</b>  | <b>99.172.506</b>  | <b>5,41</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,10% 16 - 15.04.19   | 4.900.000   | EUR                | 4.898.540          | 4.912.130          | 0,27                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,65% 15 - 01.11.20   | 120.000     | EUR                | 120.033            | 122.478            | 0,01                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,70% 15 - 01.05.20   | 4.400.000   | EUR                | 4.486.894          | 4.495.946          | 0,24                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,75% 14 - 15.01.18   | 4.100.000   | EUR                | 4.147.557          | 4.152.517          | 0,23                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,95% 16 - 15.03.23   | 28.846.000  | EUR                | 28.844.388         | 29.246.783         | 1,60                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,05% 14 - 01.12.19   | 6.700.000   | EUR                | 6.907.738          | 6.937.180          | 0,38                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,35% 15 - 15.04.22   | 23.699.000  | EUR                | 23.845.085         | 24.783.087         | 1,35                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,45% 15 - 15.09.22   | 8.124.000   | EUR                | 8.364.958          | 8.528.661          | 0,46                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |            |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                 |            |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                 |            |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50% 15 -<br>01.06.25  | 1.389.000   | EUR                | 1.395.795       | 1.429.187  | 0,08                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,60% 16 -<br>01.06.26  | 2.369.000   | EUR                | 2.404.685       | 2.445.045  | 0,13                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,65% 15 -<br>01.03.32  | 1.200.000   | EUR                | 1.151.656       | 1.190.776  | 0,06                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,00% 15 -<br>01.12.25  | 4.400.000   | EUR                | 4.624.427       | 4.691.661  | 0,26                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,15% 14 -<br>15.12.21  | 7.972.000   | EUR                | 8.519.597       | 8.699.543  | 0,47                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 04 -<br>15.09.35  | 1.786.897   | EUR                | 2.440.050       | 2.272.844  | 0,12                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,50% 14 -<br>01.05.19  | 7.000.000   | EUR                | 7.484.169       | 7.490.459  | 0,41                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,50% 14 -<br>01.12.24  | 10.000.000  | EUR                | 10.614.500      | 11.135.377 | 0,61                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,75% 13 -<br>15.11.16  | 5.925.000   | EUR                | 6.176.586       | 5.989.879  | 0,33                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,25% 15 -<br>01.09.46  | 14.594.000  | EUR                | 15.918.600      | 17.570.251 | 0,96                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 12 -<br>01.11.17  | 4.164.000   | EUR                | 4.498.411       | 4.364.290  | 0,24                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 -<br>01.06.18  | 15.953.000  | EUR                | 17.336.213      | 17.036.006 | 0,93                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 -<br>01.12.18  | 542.000     | EUR                | 588.028         | 588.177    | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 14 -<br>01.03.30  | 14.121.000  | EUR                | 17.543.008      | 17.352.671 | 0,95                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 10 -<br>01.03.21  | 7.300.000   | EUR                | 8.462.160       | 8.468.664  | 0,46                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 06 -<br>01.08.21  | 490.000     | EUR                | 557.223         | 573.322    | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 14 -<br>01.09.24  | 15.572.000  | EUR                | 18.926.249      | 18.833.968 | 1,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 05 -<br>01.02.37  | 9.508.000   | EUR                | 11.892.849      | 12.616.126 | 0,69                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 03 -<br>01.02.19  | 29.315.000  | EUR                | 32.911.463      | 32.546.475 | 1,78                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 09 -<br>01.09.19  | 2.336.000   | EUR                | 2.627.145       | 2.645.286  | 0,14                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 -<br>01.02.18  | 2.503.000   | EUR                | 2.680.011       | 2.683.764  | 0,15                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 -<br>01.08.18  | 41.411.000  | EUR                | 46.260.215      | 45.323.619 | 2,47                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 -<br>01.03.19  | 15.600.000  | EUR                | 17.628.468      | 17.476.791 | 0,95                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 04 -<br>01.02.20  | 1.400.000   | EUR                | 1.616.714       | 1.620.836  | 0,09                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 13 - 01.05.23   | 17.603.000  | EUR                | 21.638.406         | 21.988.360         | 1,20                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 13 - 01.03.24   | 25.769.000  | EUR                | 32.500.141         | 32.488.313         | 1,77                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 11 - 01.09.21   | 27.117.000  | EUR                | 32.810.047         | 33.160.110         | 1,81                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 08 - 01.08.23   | 2.427.000   | EUR                | 2.946.992          | 3.092.783          | 0,17                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 13 - 01.09.44   | 8.122.000   | EUR                | 9.906.991          | 12.247.422         | 0,67                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 11 - 01.03.22   | 1.548.000   | EUR                | 1.947.824          | 1.934.427          | 0,11                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 09 - 01.03.25   | 447.000     | EUR                | 577.955            | 589.061            | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 03 - 01.08.34   | 109.618.000 | EUR                | 156.545.556        | 160.795.356        | 8,77                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 09 - 01.09.40   | 35.282.000  | EUR                | 45.750.231         | 53.572.189         | 2,92                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 98 - 01.11.29   | 24.536.000  | EUR                | 34.242.404         | 35.119.849         | 1,92                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 - 01.09.22   | 16.674.000  | EUR                | 20.996.665         | 21.605.035         | 1,18                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 - 01.11.22   | 6.662.000   | EUR                | 8.638.448          | 8.654.471          | 0,47                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,75% 02 - 01.02.33   | 5.033.000   | EUR                | 7.589.460          | 7.844.696          | 0,43                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,00% 00 - 01.05.31   | 22.612.000  | EUR                | 34.420.891         | 35.291.844         | 1,93                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 7,25% 97 - 01.11.26   | 9.150.000   | EUR                | 14.190.173         | 14.305.169         | 0,78                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,00% 93 - 01.11.23   | 2.927.000   | EUR                | 4.565.628          | 4.611.553          | 0,25                         |
| Italy Government International Bond 5,20% 04 - 31.07.34   | 1.152.000   | EUR                | 1.477.555          | 1.643.569          | 0,09                         |
|   |             |                    | <b>756.618.782</b> | <b>777.168.006</b> | <b>42,41</b>                 |
| <b>Slowakei</b>   |             |                    |                    |                    |                              |
| Slovakia 2,125% 12 - 25.04.18   | 13.000.000  | CHF                | 12.522.536         | 12.574.946         | 0,69                         |
| Slovakia 3,00% 13 - 28.02.23  | 972.000     | EUR                | 1.147.261          | 1.169.388          | 0,06                         |
| Slovakia 3,375% 12 - 15.11.24   | 1.206.000   | EUR                | 1.451.783          | 1.523.086          | 0,08                         |
| Slovakia 4,35% 10 - 14.10.25  | 7.962.000   | EUR                | 10.121.343         | 10.984.574         | 0,60                         |
|   |             |                    | <b>25.242.923</b>  | <b>26.251.994</b>  | <b>1,43</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                    |                    |                              |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.16   | 2.749.000   | EUR                | 2.748.863          | 2.749.055          | 0,15                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.17   | 2.053.000   | EUR                | 2.051.199          | 2.054.211          | 0,11                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.17   | 400.000     | EUR                | 399.051            | 400.396            | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.18   | 2.300.000   | EUR                | 2.294.316          | 2.298.988          | 0,13                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.18   | 2.237.000   | EUR                | 2.221.369          | 2.235.322          | 0,12                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.19   | 2.162.000   | EUR                | 2.125.633          | 2.151.990          | 0,12                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.20   | 400.000     | EUR                | 392.075            | 396.784            | 0,02                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |            |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                 |            |                              |
| <b>Spanien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                 |            |                              |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.20   | 4.911.000   | EUR                | 4.745.808       | 4.862.921  | 0,27                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.21   | 400.000     | EUR                | 387.907         | 393.788    | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.21   | 4.197.000   | EUR                | 3.967.493       | 4.115.830  | 0,22                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.22   | 4.915.000   | EUR                | 4.546.906       | 4.730.786  | 0,26                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.23   | 1.158.000   | EUR                | 1.046.337       | 1.100.297  | 0,06                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.23   | 1.186.000   | EUR                | 1.065.478       | 1.112.681  | 0,06                         |
| Spain Zero Coupon – 13 - 31.10.23   | 1.100.000   | EUR                | 996.366         | 1.014.233  | 0,06                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.24   | 956.000     | EUR                | 822.689         | 871.222    | 0,05                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.25   | 3.617.000   | EUR                | 3.035.973       | 3.210.522  | 0,18                         |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.26   | 500.000     | EUR                | 419.632         | 435.590    | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.26   | 4.836.000   | EUR                | 3.886.918       | 4.126.801  | 0,23                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.27   | 5.152.000   | EUR                | 3.989.506       | 4.285.485  | 0,23                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.28   | 4.382.000   | EUR                | 3.279.463       | 3.553.802  | 0,19                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.29   | 5.094.000   | EUR                | 3.634.526       | 4.033.022  | 0,22                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.30   | 4.282.000   | EUR                | 2.991.039       | 3.301.208  | 0,18                         |
| Spain Zero Coupon – 09 - 22.06.31   | 400.000     | EUR                | 399.938         | 400.088    | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.31   | 5.682.000   | EUR                | 3.853.461       | 4.260.420  | 0,23                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.32   | 869.000     | EUR                | 638.565         | 642.313    | 0,04                         |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.32   | 1.356.000   | EUR                | 863.984         | 987.738    | 0,05                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.33   | 869.000     | EUR                | 620.178         | 626.097    | 0,03                         |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.34   | 869.000     | EUR                | 601.863         | 606.632    | 0,03                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.34   | 2.786.000   | EUR                | 1.694.614       | 1.902.114  | 0,10                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.35   | 686.000     | EUR                | 371.945         | 445.550    | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.36   | 686.000     | EUR                | 356.088         | 435.260    | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.37   | 2.786.000   | EUR                | 1.484.855       | 1.700.017  | 0,09                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.38   | 686.000     | EUR                | 329.623         | 404.452    | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.39   | 686.000     | EUR                | 314.751         | 390.032    | 0,02                         |
| Spain Zero Coupon – 07 - 30.07.40   | 1.036.000   | EUR                | 454.588         | 572.027    | 0,03                         |
| Spain Zero Coupon – 10 - 30.07.41   | 2.184.000   | EUR                | 920.240         | 1.193.731  | 0,07                         |
| Spain 0,50% 14 - 31.10.17   | 25.000.000  | EUR                | 25.191.750      | 25.223.715 | 1,38                         |
| Spain 1,95% 15 - 30.07.30   | 500.000     | EUR                | 504.047         | 523.720    | 0,03                         |
| Spain 2,15% 15 - 31.10.25   | 11.408.000  | EUR                | 11.795.382      | 12.413.641 | 0,68                         |
| Spain 2,75% 14 - 30.04.19   | 1.330.000   | EUR                | 1.428.012       | 1.434.622  | 0,08                         |
| Spain 3,80% 14 - 30.04.24   | 8.746.000   | EUR                | 10.569.252      | 10.649.348 | 0,58                         |
| Spain 4,00% 10 - 30.04.20   | 2.010.000   | EUR                | 2.293.830       | 2.313.335  | 0,13                         |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 50.006.000  | EUR                | 54.940.468      | 54.412.544 | 2,97                         |
| Spain 4,30% 09 - 31.10.19   | 2.201.000   | EUR                | 2.497.570       | 2.516.155  | 0,14                         |
| Spain 4,50% 12 - 31.01.18   | 11.660.000  | EUR                | 13.022.754      | 12.519.560 | 0,68                         |
| Spain 4,60% 09 - 30.07.19   | 4.721.000   | EUR                | 5.505.254       | 5.391.170  | 0,29                         |
| Spain 4,65% 10 - 30.07.25   | 13.643.000  | EUR                | 17.281.581      | 17.816.087 | 0,97                         |
| Spain 4,70% 09 - 30.07.41   | 7.317.000   | EUR                | 9.867.639       | 10.896.413 | 0,59                         |
| Spain 4,80% 08 - 31.01.24   | 7.739.000   | EUR                | 9.702.899       | 10.000.967 | 0,55                         |
| Spain 4,85% 10 - 31.10.20   | 11.196.000  | EUR                | 13.484.238      | 13.484.731 | 0,74                         |
| Spain 4,90% 07 - 30.07.40   | 29.626.000  | EUR                | 40.522.069      | 45.002.042 | 2,46                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.28   | 17.621.000  | EUR                | 23.010.380      | 24.883.041 | 1,36                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 54.592.000  | EUR                | 76.737.756      | 87.490.111 | 4,77                         |
| Spain 5,40% 13 - 31.01.23   | 17.816.000  | EUR                | 22.837.641      | 23.394.735 | 1,28                         |
| Spain 5,75% 01 - 30.07.32   | 35.909.000  | EUR                | 53.003.562      | 56.541.101 | 3,09                         |
| Spain 5,90% 11 - 30.07.26   | 1.684.000   | EUR                | 2.324.822       | 2.420.252  | 0,13                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten      | Marktwert            | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Spanien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                      |                      |                              |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 26.071.000  | EUR                | 37.093.776           | 39.575.934           | 2,16                         |
|   |             |                    | <b>497.567.922</b>   | <b>526.904.629</b>   | <b>28,75</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>1.678.830.587</b> | <b>1.763.999.616</b> | <b>96,26</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>1.678.830.587</b> | <b>1.763.999.616</b> | <b>96,26</b>                 |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>     |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                      |                      |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.05.18  | 1.936.000   | EUR                | 1.916.419            | 1.932.806            | 0,10                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.20  | 3.917.000   | EUR                | 3.783.077            | 3.862.436            | 0,21                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.21  | 4.545.000   | EUR                | 4.334.210            | 4.455.145            | 0,24                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.05.21  | 8.795.000   | EUR                | 8.351.525            | 8.590.780            | 0,47                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.11.21  | 5.100.000   | EUR                | 4.911.975            | 4.949.346            | 0,27                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.22  | 2.000.000   | EUR                | 1.856.170            | 1.924.320            | 0,10                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.22  | 3.200.000   | EUR                | 2.938.809            | 3.056.448            | 0,17                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.23  | 3.649.000   | EUR                | 3.371.643            | 3.446.554            | 0,19                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.24  | 1.108.000   | EUR                | 997.963              | 1.016.612            | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro Zero Coupon<br>- 00 - 01.11.24  | 1.100.000   | EUR                | 803.046              | 837.045              | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.25  | 1.744.000   | EUR                | 1.529.659            | 1.564.211            | 0,08                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.25  | 1.643.000   | EUR                | 1.385.174            | 1.443.671            | 0,08                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.26  | 1.121.000   | EUR                | 937.955              | 966.593              | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.26  | 1.186.000   | EUR                | 974.648              | 1.008.823            | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.27  | 586.000     | EUR                | 464.937              | 483.843              | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.28  | 928.000     | EUR                | 720.566              | 756.988              | 0,04                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.08.28  | 2.179.000   | EUR                | 1.676.807            | 1.756.666            | 0,10                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 02 - 01.02.29  | 2.030.000   | EUR                | 1.534.358            | 1.613.850            | 0,09                         |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten      | Marktwert            | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                      |                      |                              |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                      |                      |                              |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro Zero Coupon<br>– 98 - 01.05.30  | 1.100.000   | EUR                | 840.208              | 866.987              | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.08.30  | 1.525.000   | EUR                | 1.097.290            | 1.165.298            | 0,06                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro Zero Coupon<br>– 00 - 01.11.30  | 1.100.000   | EUR                | 818.992              | 850.619              | 0,05                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.02.31  | 2.715.000   | EUR                | 1.878.469            | 2.046.974            | 0,11                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.08.31  | 3.300.000   | EUR                | 2.279.124            | 2.447.742            | 0,13                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.02.32  | 2.438.000   | EUR                | 1.676.439            | 1.777.668            | 0,10                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 02 - 01.08.32  | 2.200.000   | EUR                | 1.480.978            | 1.582.328            | 0,09                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro Zero Coupon<br>– 05 - 01.08.36  | 800.000     | EUR                | 465.870              | 494.624              | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>– 07 - 01.02.39  | 650.000     | EUR                | 378.143              | 368.557              | 0,02                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro 0.01 – 08 -<br>01.09.16   | 400.000     | EUR                | 399.548              | 399.644              | 0,02                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro 0.01 – 13 -<br>01.09.16   | 500.000     | EUR                | 499.877              | 499.975              | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro 0.01 – 08 -<br>31.10.16   | 400.000     | EUR                | 397.052              | 397.724              | 0,02                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro 0.01 – 13 -<br>01.03.17   | 500.000     | EUR                | 499.364              | 499.970              | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro 0.01 – 13 -<br>01.09.17   | 500.000     | EUR                | 498.533              | 499.495              | 0,03                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro 0.01 – 08 -<br>01.09.17   | 400.000     | EUR                | 398.106              | 398.448              | 0,02                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.01 – 02 -<br>01.08.19   | 3.713.000   | EUR                | 3.655.459            | 3.692.319            | 0,20                         |
| Italy Buoni Poliennali del Tesoro 0.01 – 98 -<br>01.11.24   | 600.000     | EUR                | 527.051              | 538.164              | 0,03                         |
|   |             |                    | <b>60.279.444</b>    | <b>62.192.673</b>    | <b>3,39</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>60.279.444</b>    | <b>62.192.673</b>    | <b>3,39</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>60.279.444</b>    | <b>62.192.673</b>    | <b>3,39</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>1.739.110.031</b> | <b>1.826.192.289</b> | <b>99,65</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                      | <b>1.848.988.534</b> | <b>100,89</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in AUD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Oesterreichische Kontrollbank AG 1,125% 12 -<br>24.05.18  | 1.000.000   | CHF                | 1.426.917         | 1.427.179         | 4,46                         |
|   |             |                    | <b>1.426.917</b>  | <b>1.427.179</b>  | <b>4,46</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Caisse Francaise de Financement Local 2,625%<br>09 - 12.08.19   | 1.215.000   | CHF                | 1.640.368         | 1.850.298         | 5,79                         |
|   |             |                    | <b>1.640.368</b>  | <b>1.850.298</b>  | <b>5,79</b>                  |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 0,50% 15 -<br>15.02.25   | 2.886.000   | EUR                | 4.555.566         | 4.592.764         | 14,36                        |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50% 14 -<br>15.08.46   | 2.900.000   | EUR                | 6.822.724         | 6.946.959         | 21,72                        |
| Deutsche Bundespost Zero Coupon – 90 -<br>31.12.19  | 8.200.000   | EUR                | 5.979.698         | 6.278.152         | 19,63                        |
| Deutsche Hypothekenbank AG 2,50% 06 -<br>08.03.18   | 1.500.000   | CHF                | 2.230.739         | 2.167.774         | 6,78                         |
|   |             |                    | <b>19.588.727</b> | <b>19.985.649</b> | <b>62,49</b>                 |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Intesa Sanpaolo SpA 5,00% 12 - 27.01.21   | 2.000.000   | EUR                | 3.822.005         | 3.658.908         | 11,44                        |
|   |             |                    | <b>3.822.005</b>  | <b>3.658.908</b>  | <b>11,44</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands 2,75% 14 - 15.01.47   | 3.000.000   | EUR                | 5.863.709         | 7.330.317         | 22,92                        |
| Netherlands 3,25% 11 - 15.07.21   | 1.359.000   | EUR                | 2.425.770         | 2.411.640         | 7,54                         |
|   |             |                    | <b>8.289.479</b>  | <b>9.741.957</b>  | <b>30,46</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>34.767.496</b> | <b>36.663.991</b> | <b>114,64</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>34.767.496</b> | <b>36.663.991</b> | <b>114,64</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>34.767.496</b> | <b>36.663.991</b> | <b>114,64</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>37.007.258</b> | <b>115,72</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II AUSTRALIA SSA BONDS UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in AUD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Australien</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Australia 3,00% 09 - 20.09.25   | 1.251.589   | AUD                | 1.706.846         | 1.805.630         | 4,28                         |
|   |             |                    | <b>1.706.846</b>  | <b>1.805.630</b>  | <b>4,28</b>                  |
| <b>Kanada</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Province of Ontario Canada 3,00% 10 - 28.09.16  | 200.000     | EUR                | 344.174           | 337.445           | 0,80                         |
|   |             |                    | <b>344.174</b>    | <b>337.445</b>    | <b>0,80</b>                  |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50% 14 - 15.08.46  | 2.200.000   | EUR                | 5.101.302         | 5.270.107         | 12,49                        |
| KFW 5,75% 01 - 07.06.32   | 2.800.000   | GBP                | 8.390.491         | 7.873.120         | 18,66                        |
|   |             |                    | <b>13.491.793</b> | <b>13.143.227</b> | <b>31,15</b>                 |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| European Financial Stability Facility 3.875% 12 - 30.03.32  | 2.891.000   | EUR                | 5.897.757         | 6.462.321         | 15,31                        |
|   |             |                    | <b>5.897.757</b>  | <b>6.462.321</b>  | <b>15,31</b>                 |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| European Investment Bank 1,40% 05 - 20.06.17  | 597.500.000 | JPY                | 6.440.762         | 7.943.252         | 18,82                        |
| European Investment Bank 3,50% 12 - 15.04.27  | 100.000     | EUR                | 203.614           | 200.879           | 0,48                         |
| European Investment Bank 5.625% 00 - 28.09.20   | 100.000     | GBP                | 287.244           | 273.589           | 0,65                         |
| European Union 2,875% 12 - 04.04.28   | 2.800.000   | EUR                | 5.281.741         | 5.380.542         | 12,75                        |
|   |             |                    | <b>12.213.361</b> | <b>13.798.262</b> | <b>32,70</b>                 |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| United Kingdom Gilt 3,75% 11 - 22.07.52   | 2.800.000   | GBP                | 8.093.121         | 7.985.699         | 18,92                        |
|   |             |                    | <b>8.093.121</b>  | <b>7.985.699</b>  | <b>18,92</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>41.747.052</b> | <b>43.532.584</b> | <b>103,16</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>41.747.052</b> | <b>43.532.584</b> | <b>103,16</b>                |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon - 03 - 01.08.33   | 2.000.000   | EUR                | 1.934.069         | 2.064.850         | 4,89                         |
|   |             |                    | <b>1.934.069</b>  | <b>2.064.850</b>  | <b>4,89</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>1.934.069</b>  | <b>2.064.850</b>  | <b>4,89</b>                  |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>1.934.069</b>  | <b>2.064.850</b>  | <b>4,89</b>                  |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>43.681.121</b> | <b>45.597.434</b> | <b>108,05</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>45.856.562</b> | <b>108,66</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED 1-3 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Erste Group Bank AG 4,00% 11 - 20.01.21   | 400.000     | EUR                | 487.460          | 474.174          | 6,32                         |
|   |             |                    | <b>487.460</b>   | <b>474.174</b>   | <b>6,32</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| CIF Euromortgage SA 3,75% 09 - 23.10.19   | 900.000     | EUR                | 1.013.091        | 1.016.391        | 13,54                        |
|   |             |                    | <b>1.013.091</b> | <b>1.016.391</b> | <b>13,54</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Aareal Bank AG 0,125% 14 - 19.09.17   | 600.000     | EUR                | 600.827          | 602.181          | 8,02                         |
| Berlin Hyp AG 1,125% 13 - 05.02.18  | 1.000.000   | EUR                | 1.031.840        | 1.021.586        | 13,61                        |
| Berlin Hyp AG 1,375% 12 - 30.05.17  | 300.000     | EUR                | 308.902          | 304.257          | 4,05                         |
| Bundesrepublik Deutschland 0,50% 15 - 15.02.25  | 1.001.000   | EUR                | 984.680          | 1.067.679        | 14,22                        |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50% 10 - 04.01.21  | 650.000     | EUR                | 732.335          | 742.378          | 9,89                         |
| Bundesrepublik Deutschland 3,50% 09 - 04.07.19  | 600.000     | EUR                | 683.172          | 675.376          | 9,00                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,00% 07 - 04.01.18  | 1.000       | EUR                | 1.069            | 1.071            | 0,01                         |
| Bundesrepublik Deutschland 4,75% 03 - 04.07.34  | 1.000       | EUR                | 1.613            | 1.827            | 0,03                         |
| Deutsche Hypothekenbank AG 0,875% 13 - 24.01.18   | 750.000     | EUR                | 765.990          | 762.551          | 10,16                        |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 6,00% 00 - 15.06.20   | 100.000     | EUR                | 120.510          | 119.166          | 1,59                         |
| Norddeutsche Landesbank Girozentrale 1,625% 12 - 17.07.17   | 150.000     | EUR                | 155.241          | 152.557          | 2,03                         |
|   |             |                    | <b>5.386.179</b> | <b>5.450.629</b> | <b>72,61</b>                 |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Depfa ACS Bank 1,65% 04 - 20.12.16  | 100.000.000 | JPY                | 724.759          | 882.732          | 11,76                        |
|   |             |                    | <b>724.759</b>   | <b>882.732</b>   | <b>11,76</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>7.611.489</b> | <b>7.823.926</b> | <b>104,23</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>7.611.489</b> | <b>7.823.926</b> | <b>104,23</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>7.611.489</b> | <b>7.823.926</b> | <b>104,23</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>7.903.600</b> | <b>105,30</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER 2X SHORT DAILY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Brasilien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Vale SA 4.375% 10 - 24.03.18  | 1.400.000   | EUR                | 1.415.750         | 1.431.500         | 7,07                         |
|   |             |                    | <b>1.415.750</b>  | <b>1.431.500</b>  | <b>7,07</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Caisse Francaise de Financement Local 1,80%<br>07 - 09.05.17                                      | 36.000.000  | JPY                | 269.600           | 320.585           | 1,58                         |
| France OAT 1,00% 15 - 25.11.25  | 500.000     | EUR                | 531.399           | 540.483           | 2,67                         |
| France OAT 3,00% 12 - 25.04.22  | 400.000     | EUR                | 473.474           | 477.099           | 2,36                         |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 160.000     | EUR                | 244.061           | 263.999           | 1,31                         |
|   |             |                    | <b>1.518.534</b>  | <b>1.602.166</b>  | <b>7,92</b>                  |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 5,625% 98 -<br>04.01.28  | 450.000     | EUR                | 720.659           | 751.514           | 3,72                         |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.17  | 600.000     | EUR                | 603.342           | 603.648           | 2,98                         |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 7,625% 93 -<br>01.02.23   | 100.000     | USD                | 89.256            | 115.356           | 0,57                         |
|   |             |                    | <b>1.413.257</b>  | <b>1.470.518</b>  | <b>7,27</b>                  |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,50%<br>12 - 20.03.17  | 100.000     | EUR                | 106.079           | 102.213           | 0,51                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,25% 15 -<br>15.05.18  | 1.100.000   | EUR                | 1.104.033         | 1.106.514         | 5,47                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,75% 14 -<br>15.01.18  | 2.500.000   | EUR                | 2.528.379         | 2.532.022         | 12,51                        |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,50% 14 -<br>01.05.19  | 3.400.000   | EUR                | 3.626.848         | 3.638.223         | 17,98                        |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 12 -<br>01.11.17  | 1.200.000   | EUR                | 1.256.032         | 1.257.720         | 6,21                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 -<br>01.06.18  | 1.600.000   | EUR                | 1.705.564         | 1.708.620         | 8,44                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 -<br>01.12.18  | 1.600.000   | EUR                | 1.732.357         | 1.736.315         | 8,58                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 -<br>01.08.18  | 1.600.000   | EUR                | 1.749.504         | 1.751.172         | 8,65                         |
|   |             |                    | <b>13.808.796</b> | <b>13.832.799</b> | <b>68,35</b>                 |
| <b>Mexiko</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Petroleos Mexicanos 3,75% 14 - 16.04.26   | 50.000      | EUR                | 54.604            | 46.692            | 0,23                         |
|   |             |                    | <b>54.604</b>     | <b>46.692</b>     | <b>0,23</b>                  |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Netherlands Zero Coupon – 15 - 15.04.18   | 1.100.000   | EUR                | 1.109.728         | 1.111.677         | 5,49                         |
| Netherlands 2,75% 14 - 15.01.47   | 190.000     | EUR                | 266.610           | 311.160           | 1,54                         |
|   |             |                    | <b>1.376.338</b>  | <b>1.422.837</b>  | <b>7,03</b>                  |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.24   | 450.000     | EUR                | 406.449           | 417.321           | 2,06                         |
| Spain 1,60% 15 - 30.04.25   | 400.000     | EUR                | 409.183           | 421.272           | 2,08                         |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 150.000     | EUR                | 242.070           | 240.393           | 1,19                         |
|   |             |                    | <b>1.057.702</b>  | <b>1.078.986</b>  | <b>5,33</b>                  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER 2X SHORT DAILY UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| European Union 3,00% 11 - 04.09.26  | 80.000      | EUR                | 100.637           | 102.344           | 0,51                         |
|   |             |                    | <b>100.637</b>    | <b>102.344</b>    | <b>0,51</b>                  |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Barclays Bank PLC 6,625% 11 - 30.03.22  | 50.000      | EUR                | 61.038            | 58.849            | 0,29                         |
| Network Rail Infrastructure Finance PLC<br>1,375% 07 - 22.11.37   | 38.540      | GBP                | 63.567            | 73.583            | 0,36                         |
|   |             |                    | <b>124.605</b>    | <b>132.432</b>    | <b>0,65</b>                  |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| Toyota Motor Credit Corp. 1,25% 13 -<br>01.08.17  | 54.000      | EUR                | 55.134            | 54.774            | 0,27                         |
|   |             |                    | <b>55.134</b>     | <b>54.774</b>     | <b>0,27</b>                  |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>20.925.357</b> | <b>21.175.048</b> | <b>104,63</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>20.925.357</b> | <b>21.175.048</b> | <b>104,63</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>20.925.357</b> | <b>21.175.048</b> | <b>104,63</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>21.297.147</b> | <b>105,23</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GBP LIQUID CORPORATE UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in GBP)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Australien</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Westpac Banking Corp.   | 500.000     | EUR                | 386.253          | 444.165          | 13,42                        |
|   |             |                    | <b>386.253</b>   | <b>444.165</b>   | <b>13,42</b>                 |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV 2,25% 13 -<br>24.09.20   | 100.000     | EUR                | 85.468           | 90.442           | 2,73                         |
| Belgium 5,50% 98 - 28.03.28   | 1.000       | EUR                | 1.197            | 1.331            | 0,04                         |
|   |             |                    | <b>86.665</b>    | <b>91.773</b>    | <b>2,77</b>                  |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| BPCE SA 4.625% 13 - 18.07.23  | 100.000     | EUR                | 82.493           | 95.607           | 2,89                         |
| France OAT 1,75% 14 - 25.11.24  | 942.000     | EUR                | 774.305          | 897.543          | 27,11                        |
| Sanofi 1,00% 12 - 14.11.17  | 100.000     | EUR                | 81.252           | 84.345           | 2,55                         |
|   |             |                    | <b>938.050</b>   | <b>1.077.495</b> | <b>32,55</b>                 |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Bundesrepublik Deutschland 0,50% 15 -<br>15.02.25   | 500.000     | EUR                | 403.157          | 443.205          | 13,39                        |
| Commerzbank AG 1,50% 13 - 28.02.18  | 300.000     | EUR                | 246.823          | 255.674          | 7,72                         |
|   |             |                    | <b>649.980</b>   | <b>698.879</b>   | <b>21,11</b>                 |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 -<br>01.08.18  | 810.000     | EUR                | 616.923          | 736.753          | 22,26                        |
|   |             |                    | <b>616.923</b>   | <b>736.753</b>   | <b>22,26</b>                 |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| BMW Finance NV 3.875% 10 - 18.01.17   | 48.000      | EUR                | 40.386           | 40.741           | 1,23                         |
| Deutsche Telekom International Finance BV<br>6,00% 09 - 20.01.17  | 200.000     | EUR                | 153.450          | 171.742          | 5,19                         |
| Iberdrola International BV 4,25% 12 - 11.10.18  | 100.000     | EUR                | 88.508           | 90.989           | 2,75                         |
| Roche Finance Europe BV 2,00% 12 - 25.06.18   | 91.000      | EUR                | 76.694           | 78.765           | 2,38                         |
|   |             |                    | <b>359.038</b>   | <b>382.237</b>   | <b>11,55</b>                 |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Caja Rural de Navarra 3,65% 14 - 07.02.29   | 600.000     | EUR                | 521.301          | 645.856          | 19,51                        |
|   |             |                    | <b>521.301</b>   | <b>645.856</b>   | <b>19,51</b>                 |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| BP Capital Markets PLC 2,994% 12 - 18.02.19   | 66.000      | EUR                | 57.485           | 59.034           | 1,78                         |
| United Kingdom Gilt 3,25% 12 - 22.01.44   | 1.000       | GBP                | 1.193            | 1.329            | 0,04                         |
| United Kingdom Gilt 4,50% 09 - 07.09.34   | 581.000     | GBP                | 790.590          | 851.523          | 25,73                        |
|   |             |                    | <b>849.268</b>   | <b>911.886</b>   | <b>27,55</b>                 |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| Citigroup Inc. 2,375% 14 - 22.05.24   | 250.000     | EUR                | 188.421          | 226.568          | 6,84                         |
| Goldman Sachs Group Inc. 2,00% 15 -<br>27.07.23   | 250.000     | EUR                | 183.792          | 218.658          | 6,61                         |
|   |             |                    | <b>372.213</b>   | <b>445.226</b>   | <b>13,45</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>4.779.691</b> | <b>5.434.270</b> | <b>164,17</b>                |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>4.779.691</b> | <b>5.434.270</b> | <b>164,17</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>4.779.691</b> | <b>5.434.270</b> | <b>164,17</b>                |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>5.499.529</b> | <b>166,14</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BOT UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert  | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |            |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                 |            |                           |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                 |            |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,30% 15 - 15.10.18   | 1.655.000   | EUR                | 1.664.572       | 1.669.564  | 0,93                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,65% 15 - 01.11.20   | 900.000     | EUR                | 913.793         | 918.585    | 0,51                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,75% 14 - 15.01.18   | 14.822.000  | EUR                | 15.001.862      | 15.011.854 | 8,37                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,05% 14 - 01.12.19   | 9.100.000   | EUR                | 9.395.847       | 9.422.140  | 5,25                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,15% 14 - 15.05.17   | 23.250.000  | EUR                | 23.663.493      | 23.521.792 | 13,12                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,35% 15 - 15.04.22   | 500.000     | EUR                | 521.130         | 522.872    | 0,29                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50% 14 - 15.12.16   | 865.000     | EUR                | 880.116         | 871.487    | 0,49                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50% 14 - 01.08.19   | 6.853.000   | EUR                | 7.119.533       | 7.160.831  | 3,99                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50% 15 - 01.06.25   | 900.000     | EUR                | 922.061         | 926.039    | 0,52                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 11 - 15.09.16   | 12.933.259  | EUR                | 13.168.600      | 13.017.972 | 7,26                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 06 - 15.09.17   | 11.194.546  | EUR                | 11.812.111      | 11.539.338 | 6,44                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,75% 13 - 15.11.16   | 19.745.000  | EUR                | 20.198.450      | 19.961.208 | 11,13                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 12 - 01.11.17   | 1.175.000   | EUR                | 1.263.316       | 1.231.518  | 0,69                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 13 - 01.05.21   | 500.000     | EUR                | 579.950         | 581.417    | 0,32                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 07 - 01.02.17   | 4.430.000   | EUR                | 4.557.466       | 4.538.092  | 2,53                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 03 - 01.02.19   | 21.442.000  | EUR                | 23.759.716      | 23.805.612 | 13,28                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 - 01.02.18   | 16.925.000  | EUR                | 18.134.422      | 18.147.305 | 10,12                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 - 01.08.18   | 18.746.000  | EUR                | 20.952.003      | 20.517.171 | 11,44                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 04 - 01.02.20   | 500.000     | EUR                | 577.934         | 578.870    | 0,32                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 13 - 01.03.24   | 500.000     | EUR                | 628.420         | 630.376    | 0,35                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 11 - 01.03.22   | 300.000     | EUR                | 373.809         | 374.889    | 0,21                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 03 - 01.08.34   | 500.000     | EUR                | 724.776         | 733.435    | 0,41                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 02 - 01.08.17   | 1.869.000   | EUR                | 1.976.092       | 1.977.738  | 1,10                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 98 - 01.11.29   | 500.000     | EUR                | 710.749         | 715.680    | 0,40                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BOT UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 -<br>01.09.22  | 600.000     | EUR                | 774.912            | 777.439            | 0,43                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 -<br>01.11.22  | 600.000     | EUR                | 776.716            | 779.448            | 0,44                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 -<br>01.11.27  | 200.000     | EUR                | 302.310            | 303.950            | 0,17                      |
|   |             |                    | <b>181.354.159</b> | <b>180.236.622</b> | <b>100,51</b>             |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>181.354.159</b> | <b>180.236.622</b> | <b>100,51</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>181.354.159</b> | <b>180.236.622</b> | <b>100,51</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>181.354.159</b> | <b>180.236.622</b> | <b>100,51</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>181.818.826</b> | <b>101,39</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY AGGREGATE UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                              |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,65% 15 -<br>01.03.32  | 5.642.000   | EUR                | 5.240.601         | 5.598.634         | 7,53                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 04 -<br>15.09.35  | 1.791.675   | EUR                | 2.208.051         | 2.278.921         | 3,07                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 14 -<br>01.09.24  | 1.283.000   | EUR                | 1.473.821         | 1.551.758         | 2,09                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 05 -<br>01.02.37  | 4.468.000   | EUR                | 5.623.488         | 5.928.571         | 7,98                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 13 -<br>01.05.23  | 4.658.000   | EUR                | 5.713.223         | 5.818.428         | 7,83                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 10 -<br>01.03.26  | 2.646.000   | EUR                | 3.303.753         | 3.416.356         | 4,60                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 12 -<br>01.06.17  | 4.500.000   | EUR                | 4.695.065         | 4.702.698         | 6,33                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 13 -<br>01.09.28  | 1.043.000   | EUR                | 1.396.066         | 1.411.999         | 1,90                         |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 13 -<br>01.09.44  | 7.990.000   | EUR                | 11.380.510        | 12.048.375        | 16,22                        |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 03 -<br>01.08.34  | 5.600.000   | EUR                | 7.808.024         | 8.214.472         | 11,06                        |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,50% 12 -<br>01.11.22  | 9.943.000   | EUR                | 12.751.048        | 12.916.753        | 17,39                        |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,00% 00 -<br>01.05.31  | 1.064.000   | EUR                | 1.598.261         | 1.660.646         | 2,23                         |
| Italy Government International Bond 3,70% 96<br>- 14.11.16  | 324.000.000 | JPY                | 2.480.307         | 2.878.160         | 3,87                         |
| Italy Government International Bond 6,00% 98<br>- 04.08.28  | 3.800.000   | GBP                | 5.281.434         | 5.804.085         | 7,81                         |
|   |             |                    | <b>70.953.652</b> | <b>74.229.856</b> | <b>99,91</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>70.953.652</b> | <b>74.229.856</b> | <b>99,91</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>70.953.652</b> | <b>74.229.856</b> | <b>99,91</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>70.953.652</b> | <b>74.229.856</b> | <b>99,91</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>75.130.061</b> | <b>101,12</b>                |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BTP UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>                 |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50% 15 -<br>01.06.25  | 574.000     | EUR                | 535.485           | 590.607           | 3,25                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,25% 15 -<br>01.09.46  | 1.667.000   | EUR                | 1.870.624         | 2.006.962         | 11,05                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 06 -<br>01.08.21  | 971.000     | EUR                | 1.138.498         | 1.136.114         | 6,25                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 10 -<br>01.03.26  | 2.400.000   | EUR                | 3.046.831         | 3.098.736         | 17,05                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 11 -<br>01.09.21  | 1.500.000   | EUR                | 1.334.550         | 1.834.280         | 10,09                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 13 -<br>01.09.28  | 973.000     | EUR                | 1.258.955         | 1.317.235         | 7,25                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 09 -<br>01.03.25  | 760.000     | EUR                | 971.090           | 1.001.536         | 5,51                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 07 -<br>01.08.39  | 2.896.000   | EUR                | 4.215.559         | 4.397.146         | 24,20                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50% 97 -<br>01.11.27  | 1.368.000   | EUR                | 2.012.013         | 2.079.018         | 11,44                     |
|   |             |                    | <b>16.383.605</b> | <b>17.461.634</b> | <b>96,09</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>16.383.605</b> | <b>17.461.634</b> | <b>96,09</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>16.383.605</b> | <b>17.461.634</b> | <b>96,09</b>              |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>             |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.11.16  | 1.000.000   | EUR                | 999.028           | 1.000.180         | 5,51                      |
|   |             |                    | <b>999.028</b>    | <b>1.000.180</b>  | <b>5,51</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>999.028</b>    | <b>1.000.180</b>  | <b>5,51</b>               |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare<br/>Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>999.028</b>    | <b>1.000.180</b>  | <b>5,51</b>               |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>17.382.633</b> | <b>18.461.814</b> | <b>101,60</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>18.657.739</b> | <b>102,67</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GERMANY 3-5 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 14 - 16.09.16   | 400.000     | EUR                | 400.224          | 400.480          | 15,37                     |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 - 15.09.17   | 1.000       | EUR                | 1.006            | 1.008            | 0,04                      |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 97 - 04.07.19   | 400.000     | EUR                | 405.600          | 406.784          | 15,61                     |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 97 - 04.07.20   | 400.000     | EUR                | 405.469          | 407.520          | 15,64                     |
| Bundesobligation 0,50% 12 - 07.04.17  | 297.000     | EUR                | 299.150          | 299.584          | 11,50                     |
| Bundesobligation 1,00% 14 - 22.02.19  | 139.000     | EUR                | 144.806          | 145.138          | 5,57                      |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 13 - 15.05.23  | 200.000     | EUR                | 225.777          | 227.118          | 8,72                      |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 14 - 15.05.24  | 200.000     | EUR                | 227.664          | 229.258          | 8,80                      |
| Bundesrepublik Deutschland 2,00% 13 - 15.08.23  | 350.000     | EUR                | 405.706          | 411.589          | 15,80                     |
| Bundesrepublik Deutschland 3,50% 09 - 04.07.19  | 300.000     | EUR                | 336.584          | 337.688          | 12,96                     |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>2.851.986</b> | <b>2.866.167</b> | <b>110,01</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>2.851.986</b> | <b>2.866.167</b> | <b>110,01</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>2.851.986</b> | <b>2.866.167</b> | <b>110,01</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>2.884.333</b> | <b>110,70</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA 1-3 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Bundesobligation 0,50% 12 - 13.10.17  | 260.000     | EUR                | 263.388          | 263.813          | 8,93                      |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 -<br>16.06.17  | 260.000     | EUR                | 261.290          | 261.592          | 8,85                      |
| Bundesschatzanweisungen Zero Coupon – 15 -<br>15.09.17  | 260.000     | EUR                | 261.622          | 262.037          | 8,87                      |
|   |             |                    | <b>786.300</b>   | <b>787.442</b>   | <b>26,65</b>              |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Netherlands 3,50% 10 - 15.07.20   | 1.000       | EUR                | 1.162            | 1.166            | 0,04                      |
| Netherlands 4,00% 06 - 15.07.16   | 297.000     | EUR                | 310.035          | 297.356          | 10,06                     |
| Netherlands 4,00% 08 - 15.07.18   | 312.000     | EUR                | 350.682          | 341.323          | 11,55                     |
|   |             |                    | <b>661.879</b>   | <b>639.845</b>   | <b>21,65</b>              |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Spain 4,50% 12 - 31.01.18   | 675.000     | EUR                | 724.377          | 724.760          | 24,52                     |
| Spain 5,50% 02 - 30.07.17   | 670.000     | EUR                | 710.942          | 711.084          | 24,06                     |
|   |             |                    | <b>1.435.319</b> | <b>1.435.844</b> | <b>48,58</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>2.883.498</b> | <b>2.863.131</b> | <b>96,88</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>2.883.498</b> | <b>2.863.131</b> | <b>96,88</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>2.883.498</b> | <b>2.863.131</b> | <b>96,88</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>2.934.069</b> | <b>99,28</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX GERMANY 7-10 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                  |                  |                              |
| Bundesobligation 0,25% 14 - 11.10.19  | 410.000     | EUR                | 420.396          | 422.223          | 13,89                        |
| Bundesrepublik Deutschland 2,00% 13 -<br>15.08.23   | 360.000     | EUR                | 415.447          | 423.348          | 13,92                        |
| Bundesrepublik Deutschland 3,50% 09 -<br>04.07.19   | 365.000     | EUR                | 414.501          | 410.854          | 13,51                        |
| Bundesrepublik Deutschland 6,25% 94 -<br>04.01.24   | 280.000     | EUR                | 412.127          | 422.123          | 13,88                        |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.17  | 410.000     | EUR                | 410.895          | 412.493          | 13,56                        |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.19  | 410.000     | EUR                | 411.136          | 416.954          | 13,71                        |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 -<br>04.07.20  | 410.000     | EUR                | 408.267          | 417.708          | 13,74                        |
|   |             |                    | <b>2.892.769</b> | <b>2.925.703</b> | <b>96,21</b>                 |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>2.892.769</b> | <b>2.925.703</b> | <b>96,21</b>                 |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>2.892.769</b> | <b>2.925.703</b> | <b>96,21</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>2.892.769</b> | <b>2.925.703</b> | <b>96,21</b>                 |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>2.953.986</b> | <b>97,14</b>                 |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID COVERED UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien<br>AG 1,75% 13 - 02.10.20                             | 500.000     | EUR                | 530.325           | 537.974           | 0,98                      |
|   |             |                    | <b>530.325</b>    | <b>537.974</b>    | <b>0,98</b>               |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Belgium 3,00% 14 - 22.06.34   | 500.000     | EUR                | 652.707           | 701.147           | 1,28                      |
| Belgium 5,00% 04 - 28.03.35   | 200.000     | EUR                | 330.809           | 354.091           | 0,64                      |
| Belgium 5,50% 98 - 28.03.28   | 3.000.000   | EUR                | 4.571.785         | 4.803.670         | 8,74                      |
|   |             |                    | <b>5.555.301</b>  | <b>5.858.908</b>  | <b>10,66</b>              |
| <b>Kanada</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| National Bank of Canada 1,50% 14 - 25.03.21   | 1.000.000   | EUR                | 1.056.690         | 1.073.228         | 1,95                      |
| Royal Bank of Canada 1.625% 13 - 04.08.20   | 1.000.000   | EUR                | 1.062.360         | 1.071.064         | 1,95                      |
|   |             |                    | <b>2.119.050</b>  | <b>2.144.292</b>  | <b>3,90</b>               |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Nordea Bank Finland Abp 1,25% 14 - 14.01.19   | 1.250.000   | EUR                | 1.297.725         | 1.297.238         | 2,36                      |
| OP Corporate Bank PLC 1,25% 13 - 14.05.18   | 3.000.000   | EUR                | 3.063.339         | 3.068.694         | 5,58                      |
|   |             |                    | <b>4.361.064</b>  | <b>4.365.932</b>  | <b>7,94</b>               |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| BPCE SFH SA 2,75% 12 - 16.02.17   | 400.000     | EUR                | 407.195           | 407.316           | 0,74                      |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat SA<br>3,60% 11 - 13.09.21                                    | 230.000     | EUR                | 272.267           | 274.970           | 0,50                      |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat SA<br>3,60% 12 - 08.03.24                                    | 1.000.000   | EUR                | 1.225.200         | 1.267.528         | 2,31                      |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat SA<br>3,90% 11 - 18.01.21                                    | 2.000.000   | EUR                | 2.355.269         | 2.372.920         | 4,32                      |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat SA<br>4,00% 12 - 17.06.22                                    | 400.000     | EUR                | 496.124           | 497.575           | 0,91                      |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat SA<br>4,50% 08 - 25.10.17                                    | 400.000     | EUR                | 449.948           | 424.969           | 0,77                      |
| Caisse Francaise de Financement Local 3.625%<br>10 - 26.02.18                                     | 600.000     | EUR                | 647.550           | 637.985           | 1,16                      |
| Caisse Francaise de Financement Local 4,25%<br>07 - 07.02.19                                      | 1.000.000   | EUR                | 1.164.880         | 1.116.825         | 2,03                      |
| Caisse Francaise de Financement Local 4,50%<br>07 - 13.11.17                                      | 800.000     | EUR                | 903.992           | 851.579           | 1,55                      |
| Cie de Financement Foncier SA 2,00% 14 -<br>07.05.24  | 800.000     | EUR                | 878.104           | 913.827           | 1,66                      |
| Cie de Financement Foncier SA 2,375% 05 -<br>24.08.18   | 5.000.000   | CHF                | 4.949.162         | 4.923.140         | 8,95                      |
| Credit Agricole Home Loan SFH SA 2,125%<br>12 - 10.07.17  | 1.000.000   | EUR                | 1.039.480         | 1.024.097         | 1,86                      |
| Credit Agricole Home Loan SFH SA 4,00% 10<br>- 16.07.25   | 700.000     | EUR                | 900.060           | 931.978           | 1,70                      |
| Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH 1,75%<br>14 - 19.06.24  | 400.000     | EUR                | 428.412           | 451.027           | 0,82                      |
| France OAT 1,75% 13 - 25.05.23  | 2.250.000   | EUR                | 2.525.001         | 2.552.524         | 4,64                      |
| France OAT 1,75% 14 - 25.11.24  | 1.800.000   | EUR                | 2.019.564         | 2.063.712         | 3,75                      |
| France OAT 3,25% 13 - 25.05.45  | 1.550.000   | EUR                | 2.307.447         | 2.463.140         | 4,48                      |
|   |             |                    | <b>22.969.655</b> | <b>23.175.112</b> | <b>42,15</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID COVERED UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Commerzbank AG 4,375% 09 - 02.07.19   | 336.000     | EUR                | 381.217           | 382.408           | 0,70                      |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 7,625% 93 - 01.02.23  | 2.500.000   | USD                | 2.826.120         | 2.883.907         | 5,24                      |
| Norddeutsche Landesbank Girozentrale 1,625% 12 - 17.07.17   | 250.000     | EUR                | 254.100           | 254.261           | 0,46                      |
|   |             |                    | <b>3.461.437</b>  | <b>3.520.576</b>  | <b>6,40</b>               |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Depfa ACS Bank 1,65% 04 - 20.12.16  | 100.000.000 | JPY                | 784.663           | 882.732           | 1,61                      |
|   |             |                    | <b>784.663</b>    | <b>882.732</b>    | <b>1,61</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,75% 13 - 15.11.16   | 4.648.000   | EUR                | 4.695.800         | 4.698.896         | 8,54                      |
| UniCredit SpA 2,625% 13 - 31.10.20  | 300.000     | EUR                | 331.974           | 334.025           | 0,61                      |
|   |             |                    | <b>5.027.774</b>  | <b>5.032.921</b>  | <b>9,15</b>               |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| ABN AMRO Bank NV 1,875% 12 - 31.07.19   | 1.250.000   | EUR                | 1.341.537         | 1.332.218         | 2,42                      |
|   |             |                    | <b>1.341.537</b>  | <b>1.332.218</b>  | <b>2,42</b>               |
| <b>Neuseeland</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| BNZ International Funding Ltd. 3.125% 10 - 23.11.17   | 400.000     | EUR                | 417.743           | 417.969           | 0,76                      |
|   |             |                    | <b>417.743</b>    | <b>417.969</b>    | <b>0,76</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Banco Santander SA 4,75% 12 - 24.01.17  | 400.000     | EUR                | 437.728           | 410.732           | 0,75                      |
| Bankia SA 4,50% 07 - 26.04.22   | 400.000     | EUR                | 494.772           | 498.028           | 0,90                      |
| CaixaBank SA 3,00% 13 - 22.03.18  | 800.000     | EUR                | 870.528           | 841.556           | 1,53                      |
|   |             |                    | <b>1.803.028</b>  | <b>1.750.316</b>  | <b>3,18</b>               |
| <b>Schweden</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Swedbank AB 1,50% 14 - 18.03.19   | 1.500.000   | EUR                | 1.556.350         | 1.562.154         | 2,84                      |
|   |             |                    | <b>1.556.350</b>  | <b>1.562.154</b>  | <b>2,84</b>               |
| <b>Schweiz</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| UBS AG 1.375% 14 - 16.04.21   | 1.000.000   | EUR                | 1.052.550         | 1.067.670         | 1,94                      |
|   |             |                    | <b>1.052.550</b>  | <b>1.067.670</b>  | <b>1,94</b>               |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Royal Bank of Scotland PLC 3.875% 10 - 19.10.20   | 1.000.000   | EUR                | 1.190.850         | 1.163.155         | 2,12                      |
| Santander UK PLC 4,25% 06 - 12.04.21  | 400.000     | EUR                | 489.364           | 478.862           | 0,87                      |
|   |             |                    | <b>1.680.214</b>  | <b>1.642.017</b>  | <b>2,99</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>52.660.691</b> | <b>53.290.791</b> | <b>96,92</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>52.660.691</b> | <b>53.290.791</b> | <b>96,92</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>52.660.691</b> | <b>53.290.791</b> | <b>96,92</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>53.869.712</b> | <b>97,98</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 1-3 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro Zero Coupon –<br>16 - 14.02.17  | 673.000     | EUR                | 673.181          | 673.848          | 14,04                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50% 14 -<br>01.08.19  | 340.000     | EUR                | 344.046          | 355.273          | 7,40                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 -<br>01.06.18  | 300.000     | EUR                | 320.006          | 320.366          | 6,67                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 -<br>01.12.18  | 637.000     | EUR                | 699.878          | 691.270          | 14,40                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 09 -<br>01.09.19  | 748.000     | EUR                | 866.745          | 847.035          | 17,64                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 -<br>01.02.18  | 770.000     | EUR                | 863.239          | 825.609          | 17,20                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 12 -<br>01.05.17  | 400.000     | EUR                | 442.576          | 416.460          | 8,68                      |
| Italy Government International Bond 5,75% 01<br>- 25.07.16  | 680.000     | EUR                | 742.975          | 682.074          | 14,21                     |
|   |             |                    | <b>4.952.646</b> | <b>4.811.935</b> | <b>100,24</b>             |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>4.952.646</b> | <b>4.811.935</b> | <b>100,24</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>4.952.646</b> | <b>4.811.935</b> | <b>100,24</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>4.952.646</b> | <b>4.811.935</b> | <b>100,24</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>4.881.337</b> | <b>101,68</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 3-5 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,30% 15 - 15.10.18   | 897.000     | EUR                | 899.588          | 904.894          | 22,41                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,70% 15 - 01.05.20   | 800.000     | EUR                | 810.394          | 817.445          | 20,24                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,75% 14 - 15.01.18   | 600.000     | EUR                | 607.236          | 607.685          | 15,05                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 12 - 01.11.17   | 500.000     | EUR                | 541.820          | 524.050          | 12,98                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 - 01.12.18   | 500.000     | EUR                | 549.355          | 542.598          | 13,44                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,00% 10 - 01.09.20   | 536.000     | EUR                | 587.885          | 621.126          | 15,38                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 03 - 01.02.19   | 450.000     | EUR                | 508.500          | 499.605          | 12,37                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 04 - 01.02.20   | 504.000     | EUR                | 566.682          | 583.501          | 14,45                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 08 - 01.08.23   | 732.000     | EUR                | 904.847          | 932.805          | 23,10                     |
|   |             |                    | <b>5.976.307</b> | <b>6.033.709</b> | <b>149,42</b>             |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>5.976.307</b> | <b>6.033.709</b> | <b>149,42</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>5.976.307</b> | <b>6.033.709</b> | <b>149,42</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>5.976.307</b> | <b>6.033.709</b> | <b>149,42</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>6.080.489</b> | <b>150,57</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II CANADIAN DOLLAR CASH UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in CAD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Austria 3,80% 12 - 26.01.62   | 1.000.000   | EUR                | 2.275.433         | 2.890.792         | 10,45                     |
| UniCredit Bank Austria AG FRN 01 - 25.01.31   | 2.000.000   | EUR                | 1.940.218         | 1.741.292         | 6,29                      |
|   |             |                    | <b>4.215.651</b>  | <b>4.632.084</b>  | <b>16,74</b>              |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Belgium 5,00% 04 - 28.03.35   | 362.000     | EUR                | 804.290           | 924.691           | 3,34                      |
|   |             |                    | <b>804.290</b>    | <b>924.691</b>    | <b>3,34</b>               |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| French Treasury Note BTAN 1,75% 12 - 25.02.17   | 480.000     | EUR                | 706.571           | 702.789           | 2,54                      |
|   |             |                    | <b>706.571</b>    | <b>702.789</b>    | <b>2,54</b>               |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Bundesrepublik Deutschland 1,50% 13 - 15.05.23  | 1.907.000   | EUR                | 3.083.737         | 3.124.471         | 11,30                     |
| Bundesrepublik Deutschland 2,00% 13 - 15.08.23  | 1.300.000   | EUR                | 2.201.233         | 2.205.676         | 7,97                      |
| Deutsche Hypothekenbank AG 2,50% 06 - 08.03.18  | 2.300.000   | CHF                | 3.365.516         | 3.214.271         | 11,62                     |
|   |             |                    | <b>8.650.486</b>  | <b>8.544.418</b>  | <b>30,89</b>              |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 - 15.04.17  | 400.000.000 | JPY                | 4.616.809         | 5.080.108         | 18,36                     |
|   |             |                    | <b>4.616.809</b>  | <b>5.080.108</b>  | <b>18,36</b>              |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 557.000     | EUR                | 874.751           | 874.450           | 3,16                      |
|   |             |                    | <b>874.751</b>    | <b>874.450</b>    | <b>3,16</b>               |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| European Investment Bank 4,50% 09 - 15.10.25  | 2.200.000   | EUR                | 4.495.971         | 4.478.450         | 16,19                     |
|   |             |                    | <b>4.495.971</b>  | <b>4.478.450</b>  | <b>16,19</b>              |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| United Kingdom Gilt 2,50% 15 - 22.07.65   | 700.000     | GBP                | 1.382.416         | 1.623.493         | 5,87                      |
|   |             |                    | <b>1.382.416</b>  | <b>1.623.493</b>  | <b>5,87</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>25.746.945</b> | <b>26.860.483</b> | <b>97,09</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>25.746.945</b> | <b>26.860.483</b> | <b>97,09</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II CANADIAN DOLLAR CASH UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in CAD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Japanese Government CPI Linked Bond 1,20%<br>07 - 10.03.17  | 102.700.000 | JPY                | 1.165.554         | 1.350.198         | 4,88                      |
|   |             |                    | <b>1.165.554</b>  | <b>1.350.198</b>  | <b>4,88</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>1.165.554</b>  | <b>1.350.198</b>  | <b>4,88</b>               |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>1.165.554</b>  | <b>1.350.198</b>  | <b>4,88</b>               |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>26.912.499</b> | <b>28.210.681</b> | <b>101,97</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>28.456.901</b> | <b>102,86</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Belgium Zero Coupon – 02 - 28.09.17   | 1.251.000   | EUR                | 1.253.490          | 1.259.845          | 0,15                      |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.20   | 4.308.000   | EUR                | 4.289.728          | 4.374.343          | 0,52                      |
| Belgium 1,25% 13 - 22.06.18   | 2.074.000   | EUR                | 2.153.051          | 2.149.183          | 0,25                      |
| Belgium 3,00% 12 - 28.09.19   | 75.399.000  | EUR                | 84.544.628         | 84.137.548         | 10,03                     |
| Belgium 3,50% 11 - 28.06.17   | 48.425.000  | EUR                | 51.942.503         | 50.357.627         | 6,00                      |
| Belgium 4,25% 11 - 28.09.21   | 1.194.000   | EUR                | 1.470.967          | 1.488.273          | 0,18                      |
|   |             |                    | <b>145.654.367</b> | <b>143.766.819</b> | <b>17,13</b>              |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| France OAT 3,75% 09 - 25.10.19  | 600.000     | EUR                | 683.424            | 684.762            | 0,08                      |
| France OAT 4,00% 08 - 25.04.18  | 800.000     | EUR                | 865.604            | 866.255            | 0,10                      |
| France OAT 4,25% 07 - 25.10.17  | 600.000     | EUR                | 637.941            | 637.866            | 0,08                      |
| France OAT 4,25% 08 - 25.10.18  | 400.000     | EUR                | 444.096            | 444.504            | 0,05                      |
|   |             |                    | <b>2.631.065</b>   | <b>2.633.387</b>   | <b>0,31</b>               |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Ireland 5,00% 10 - 18.10.20   | 343.000     | EUR                | 423.486            | 419.725            | 0,05                      |
| Ireland 5,90% 09 - 18.10.19   | 996.000     | EUR                | 1.215.777          | 1.197.851          | 0,14                      |
|   |             |                    | <b>1.639.263</b>   | <b>1.617.576</b>   | <b>0,19</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro 0,01 – 15 - 14.10.16  | 400.000     | EUR                | 400.007            | 400.092            | 0,05                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,65% 15 - 01.11.20   | 20.800.000  | EUR                | 21.016.453         | 21.229.520         | 2,53                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,70% 15 - 01.05.20   | 6.077.000   | EUR                | 6.135.586          | 6.209.514          | 0,74                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50% 14 - 01.08.19   | 9.043.000   | EUR                | 9.369.820          | 9.449.203          | 1,13                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,70% 13 - 15.09.18   | 1.206.083   | EUR                | 1.304.055          | 1.263.794          | 0,15                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 11 - 15.09.16   | 18.184.220  | EUR                | 18.491.565         | 18.303.327         | 2,18                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10% 06 - 15.09.17   | 2.235.426   | EUR                | 2.374.768          | 2.304.277          | 0,28                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,75% 13 - 15.11.16   | 5.100.000   | EUR                | 5.152.763          | 5.155.845          | 0,61                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 12 - 01.11.17   | 19.422.000  | EUR                | 20.785.749         | 20.356.208         | 2,43                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 - 01.06.18   | 34.777.000  | EUR                | 37.921.600         | 37.137.917         | 4,43                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,50% 13 - 01.12.18   | 16.600.000  | EUR                | 18.207.005         | 18.014.265         | 2,15                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 06 - 01.08.21   | 1.796.000   | EUR                | 2.087.760          | 2.101.401          | 0,25                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 14 - 01.09.24   | 22.900.000  | EUR                | 27.363.210         | 27.697.012         | 3,30                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 03 - 01.02.19   | 8.193.000   | EUR                | 9.255.829          | 9.096.137          | 1,08                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 09 - 01.09.19   | 19.468.000  | EUR                | 22.171.169         | 22.045.563         | 2,63                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,25% 09 - 01.03.20   | 875.000     | EUR                | 1.030.654          | 1.008.175          | 0,12                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 - 01.02.18   | 13.303.000  | EUR                | 14.703.160         | 14.263.728         | 1,70                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 - 01.08.18   | 8.993.000   | EUR                | 10.080.244         | 9.842.682          | 1,17                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 08 - 01.03.19   | 40.619.000  | EUR                | 45.711.404         | 45.505.754         | 5,42                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 04 - 01.02.20   | 24.866.000  | EUR                | 28.659.259         | 28.788.363         | 3,43                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 12 - 01.06.17   | 28.431.000  | EUR                | 29.976.274         | 29.711.646         | 3,54                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 11 - 01.09.21   | 2.288.000   | EUR                | 2.789.164          | 2.797.888          | 0,33                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 02 - 01.08.17   | 19.731.000  | EUR                | 21.082.826         | 20.878.949         | 2,49                      |
| Italy Government International Bond 2,50% 06 - 30.01.18   | 2.600.000   | CHF                | 2.467.637          | 2.506.029          | 0,30                      |
|   |             |                    | <b>358.537.961</b> | <b>356.067.289</b> | <b>42,44</b>              |
| <b>Slowakei</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Slovakia 4,625% 12 - 19.01.17   | 4.892.000   | EUR                | 5.319.952          | 5.017.724          | 0,60                      |
|   |             |                    | <b>5.319.952</b>   | <b>5.017.724</b>   | <b>0,60</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.18   | 1.478.000   | EUR                | 1.462.075          | 1.476.892          | 0,18                      |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.19   | 2.502.000   | EUR                | 2.446.160          | 2.490.416          | 0,30                      |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.20   | 254.000     | EUR                | 242.350            | 251.513            | 0,03                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.22   | 3.300.000   | EUR                | 3.138.339          | 3.210.603          | 0,38                      |
| Spain 0.01 – 14 - 14.10.16  | 500.000     | EUR                | 492.472            | 495.720            | 0,06                      |
| Spain 0.01 – 98 - 31.01.19  | 400.000     | EUR                | 396.744            | 399.588            | 0,05                      |
| Spain 0.01 – 14 - 30.04.19  | 500.000     | EUR                | 496.033            | 498.010            | 0,06                      |
| Spain 0.01 – 10 - 31.10.20  | 500.000     | EUR                | 487.862            | 495.670            | 0,06                      |
| Spain 0.01 – 01 - 30.07.21  | 600.000     | EUR                | 576.478            | 588.396            | 0,07                      |
| Spain 0,25% 16 - 31.01.19   | 1.105.000   | EUR                | 1.109.565          | 1.114.139          | 0,13                      |
| Spain 0,50% 14 - 31.10.17   | 6.786.000   | EUR                | 6.841.570          | 6.846.725          | 0,82                      |
| Spain 1,15% 15 - 30.07.20   | 2.028.000   | EUR                | 2.086.036          | 2.117.963          | 0,25                      |
| Spain 2,10% 13 - 30.04.17   | 31.953.000  | EUR                | 32.774.442         | 32.567.137         | 3,88                      |
| Spain 2,75% 14 - 30.04.19   | 26.152.000  | EUR                | 28.122.494         | 28.209.208         | 3,36                      |
| Spain 3,80% 06 - 31.01.17   | 204.000     | EUR                | 216.171            | 208.723            | 0,03                      |
| Spain 4,00% 10 - 30.04.20   | 47.124.000  | EUR                | 54.154.643         | 54.235.629         | 6,46                      |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 19.072.000  | EUR                | 20.967.855         | 20.752.630         | 2,47                      |
| Spain 4,25% 11 - 31.10.16   | 1.096.000   | EUR                | 1.146.219          | 1.112.002          | 0,13                      |
| Spain 4,30% 09 - 31.10.19   | 44.937.000  | EUR                | 51.992.929         | 51.371.394         | 6,12                      |
| Spain 4,50% 12 - 31.01.18   | 43.507.000  | EUR                | 47.735.885         | 46.714.279         | 5,57                      |
| Spain 4,60% 09 - 30.07.19   | 9.434.000   | EUR                | 10.912.480         | 10.773.203         | 1,28                      |
| Spain 5,50% 02 - 30.07.17   | 35.560.000  | EUR                | 39.823.229         | 37.740.536         | 4,50                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |               |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                    |                    |                           |
| <b>Spanien (Fortsetzung)</b>  |               |                    |                    |                    |                           |
| Spain 5,50% 11 - 30.04.21   | 8.606.000     | EUR                | 10.711.891         | 10.806.337         | 1,29                      |
|   |               |                    | <b>318.333.922</b> | <b>314.476.713</b> | <b>37,48</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |               |                    | <b>832.116.530</b> | <b>823.579.508</b> | <b>98,15</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |               |                    | <b>832.116.530</b> | <b>823.579.508</b> | <b>98,15</b>              |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |               |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen</b>   |               |                    |                    |                    |                           |
| <b>Italien</b>  |               |                    |                    |                    |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 12 - 01.11.17  | 13.538.000    | EUR                | 13.364.919         | 13.536.105         | 1,61                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 03 - 01.02.19  | 325.000       | EUR                | 320.782            | 324.630            | 0,04                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon<br>- 98 - 01.11.20  | 2.496.000     | EUR                | 2.373.798          | 2.452.844          | 0,29                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.01 - 98 -<br>01.05.20   | 2.500.000     | EUR                | 2.456.253          | 2.471.050          | 0,30                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.01 - 02 -<br>01.02.23   | 800.000       | EUR                | 742.774            | 755.616            | 0,09                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.01 - 02 -<br>01.08.24   | 600.000       | EUR                | 528.306            | 545.724            | 0,07                      |
| Italy Government International Bond FRN 08 -<br>24.04.18  | 2.600.000.000 | JPY                | 18.294.924         | 22.503.450         | 2,68                      |
|   |               |                    | <b>38.081.756</b>  | <b>42.589.419</b>  | <b>5,08</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |               |                    | <b>38.081.756</b>  | <b>42.589.419</b>  | <b>5,08</b>               |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |               |                    | <b>38.081.756</b>  | <b>42.589.419</b>  | <b>5,08</b>               |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |               |                    | <b>870.198.286</b> | <b>866.168.927</b> | <b>103,23</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |               |                    |                    | <b>877.207.914</b> | <b>104,55</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SPAIN UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.19   | 1.000       | EUR                | 978              | 999              | 0,10                      |
| Spain 4,80% 08 - 31.01.24   | 200.000     | EUR                | 205.512          | 258.456          | 24,73                     |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.28   | 185.000     | EUR                | 210.472          | 261.243          | 25,00                     |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 170.000     | EUR                | 286.509          | 272.445          | 26,07                     |
| Spain 5,85% 11 - 31.01.22   | 196.000     | EUR                | 249.957          | 255.874          | 24,49                     |
| Spain 5,90% 11 - 30.07.26   | 177.000     | EUR                | 197.091          | 254.385          | 24,34                     |
|   |             |                    | <b>1.150.519</b> | <b>1.303.402</b> | <b>124,73</b>             |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>1.150.519</b> | <b>1.303.402</b> | <b>124,73</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>1.150.519</b> | <b>1.303.402</b> | <b>124,73</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>1.150.519</b> | <b>1.303.402</b> | <b>124,73</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>1.333.955</b> | <b>127,65</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX SPAIN 1-3 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Spain 0,50% 14 - 31.10.17   | 850.000     | EUR                | 855.678          | 857.607          | 14,33                     |
| Spain 2,10% 13 - 30.04.17   | 1.100.000   | EUR                | 1.119.894        | 1.121.142        | 18,74                     |
| Spain 2,75% 14 - 31.10.24   | 852.000     | EUR                | 923.297          | 970.863          | 16,23                     |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 832.000     | EUR                | 937.780          | 905.316          | 15,13                     |
| Spain 4,25% 11 - 31.10.16   | 893.000     | EUR                | 958.216          | 906.038          | 15,14                     |
| Spain 4,30% 09 - 31.10.19   | 1.000       | EUR                | 1.135            | 1.143            | 0,02                      |
| Spain 4,50% 12 - 31.01.18   | 1.301.000   | EUR                | 1.396.528        | 1.396.908        | 23,34                     |
|   |             |                    | <b>6.192.528</b> | <b>6.159.017</b> | <b>102,93</b>             |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>6.192.528</b> | <b>6.159.017</b> | <b>102,93</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>6.192.528</b> | <b>6.159.017</b> | <b>102,93</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>6.192.528</b> | <b>6.159.017</b> | <b>102,93</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>6.262.447</b> | <b>104,65</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in JPY)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten      | Marktwert            | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|----------------------|----------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                      |                      |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                      |                      |                           |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                      |                      |                           |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 13 - 20.03.18   | 550.000.000 | JPY                | 553.685.000          | 553.674.000          | 8,52                      |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 15 - 20.03.20   | 135.000.000 | JPY                | 135.479.199          | 137.003.400          | 2,11                      |
| Japan Government Five Year Bond 0,20% 12 - 20.06.17   | 789.300.000 | JPY                | 791.684.994          | 793.088.640          | 12,20                     |
| Japan Government Ten Year Bond 0,30% 15 - 20.12.24  | 35.000.000  | JPY                | 36.183.579           | 36.779.750           | 0,57                      |
| Japan Government Ten Year Bond 0,80% 12 - 20.09.22  | 500.000.000 | JPY                | 522.185.000          | 535.145.000          | 8,23                      |
| Japan Government Ten Year Bond 0,80% 13 - 20.06.23  | 580.600.000 | JPY                | 607.392.302          | 626.479.012          | 9,63                      |
| Japan Government Ten Year Bond 1,70% 06 - 20.12.16  | 480.000.000 | JPY                | 495.556.800          | 484.324.800          | 7,45                      |
| Japan Government Ten Year Bond 1,70% 07 - 20.03.17  | 600.000.000 | JPY                | 621.456.000          | 608.436.000          | 9,36                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,70% 13 - 20.12.43   | 90.000.000  | JPY                | 107.157.500          | 128.245.500          | 1,97                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,80% 13 - 20.09.43   | 70.000.000  | JPY                | 96.576.900           | 101.334.800          | 1,56                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 2,00% 11 - 20.09.41   | 440.000.000 | JPY                | 537.372.000          | 645.260.000          | 9,92                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 2,00% 12 - 20.03.42   | 16.600.000  | JPY                | 23.067.526           | 24.492.304           | 0,38                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 2,20% 11 - 20.03.41   | 105.000.000 | JPY                | 130.037.250          | 158.050.200          | 2,43                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 2,50% 07 - 20.09.37   | 8.100.000   | JPY                | 11.589.233           | 12.213.828           | 0,19                      |
| Japan Government Twenty Year Bond 1,70% 12 - 20.09.32   | 400.000     | JPY                | 496.572              | 514.064              | 0,01                      |
| Japan Government Twenty Year Bond 1,90% 10 - 20.09.30   | 150.000.000 | JPY                | 183.175.501          | 193.246.500          | 2,97                      |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,00% 11 - 20.12.30   | 700.000.000 | JPY                | 883.512.001          | 915.012.000          | 14,07                     |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 - 15.01.17  | 476.000.000 | JPY                | 476.276.107          | 476.947.240          | 7,33                      |
|   |             |                    | <b>6.212.883.464</b> | <b>6.430.247.038</b> | <b>98,90</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>6.212.883.464</b> | <b>6.430.247.038</b> | <b>98,90</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>6.212.883.464</b> | <b>6.430.247.038</b> | <b>98,90</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>6.212.883.464</b> | <b>6.430.247.038</b> | <b>98,90</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                      | <b>6.440.009.337</b> | <b>99,05</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN SHORT DAILY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in JPY)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| CIF Euromortgage SA 2,00% 10 - 30.01.19   | 800.000     | CHF                | 105.857.504        | 89.793.948         | 12,14                     |
|   |             |                    | <b>105.857.504</b> | <b>89.793.948</b>  | <b>12,14</b>              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Bundesrepublik Deutschland 3,25% 09 - 04.01.20  | 1.000       | EUR                | 161.203            | 129.747            | 0,02                      |
| Bundesrepublik Deutschland 3,75% 08 - 04.01.19  | 300.000     | EUR                | 39.542.874         | 38.000.363         | 5,13                      |
|   |             |                    | <b>39.704.077</b>  | <b>38.130.110</b>  | <b>5,15</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Italy Government International Bond 3,70% 96 - 14.11.16   | 51.000.000  | JPY                | 51.619.063         | 51.634.440         | 6,98                      |
|   |             |                    | <b>51.619.063</b>  | <b>51.634.440</b>  | <b>6,98</b>               |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Japan Government Ten Year Bond 0,10% 16 - 20.06.26  | 185.000.000 | JPY                | 189.751.461        | 191.210.450        | 25,85                     |
| Japan Government Ten Year Bond 1,10% 10 - 20.06.20  | 50.300.000  | JPY                | 52.725.466         | 53.116.800         | 7,18                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 1,70% 13 - 20.12.43   | 85.000.000  | JPY                | 92.403.500         | 121.120.750        | 16,38                     |
|   |             |                    | <b>334.880.427</b> | <b>365.448.000</b> | <b>49,41</b>              |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 1.100.000   | EUR                | 210.742.128        | 190.311.694        | 25,73                     |
|   |             |                    | <b>210.742.128</b> | <b>190.311.694</b> | <b>25,73</b>              |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| United Kingdom Gilt 3,50% 14 - 22.01.45   | 1.000       | GBP                | 223.530            | 191.312            | 0,03                      |
|   |             |                    | <b>223.530</b>     | <b>191.312</b>     | <b>0,03</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>743.026.729</b> | <b>735.509.504</b> | <b>99,44</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>     |             |                    | <b>743.026.729</b> | <b>735.509.504</b> | <b>99,44</b>              |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Kanada</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Canada 3,25% 10 - 01.06.21  | 1.000       | CAD                | 101.259            | 89.148             | 0,01                      |
|   |             |                    | <b>101.259</b>     | <b>89.148</b>      | <b>0,01</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>101.259</b>     | <b>89.148</b>      | <b>0,01</b>               |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>101.259</b>     | <b>89.148</b>      | <b>0,01</b>               |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>743.127.988</b> | <b>735.598.652</b> | <b>99,45</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>741.316.221</b> | <b>100,22</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Austria 0,75% 16 - 20.10.26   | 13.100.000  | EUR                | 14.941.758         | 15.367.702         | 1,58                      |
| Austria 1,95% 12 - 18.06.19   | 939.000     | EUR                | 1.125.998          | 1.119.010          | 0,11                      |
| Austria 3,15% 12 - 20.06.44   | 2.000.000   | EUR                | 3.387.664          | 3.553.043          | 0,37                      |
| Austria 3,65% 11 - 20.04.22   | 1.280.000   | EUR                | 1.750.487          | 1.752.346          | 0,18                      |
| Austria 4,15% 07 - 15.03.37   | 1.700.000   | EUR                | 3.084.542          | 3.182.642          | 0,33                      |
|   |             |                    | <b>24.290.449</b>  | <b>24.974.743</b>  | <b>2,57</b>               |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.23   | 515.000     | EUR                | 611.988            | 577.351            | 0,06                      |
| Belgium Zero Coupon – 98 - 28.03.24   | 607.000     | EUR                | 707.398            | 672.917            | 0,07                      |
| Belgium 2,60% 14 - 22.06.24   | 8.000.000   | EUR                | 10.736.059         | 10.776.090         | 1,11                      |
| Belgium 3,00% 12 - 28.09.19   | 1.800.000   | EUR                | 2.250.338          | 2.231.470          | 0,23                      |
| Belgium 4,00% 07 - 28.03.17   | 115.000     | EUR                | 135.207            | 132.014            | 0,01                      |
| Belgium 5,50% 98 - 28.03.28   | 260.000     | EUR                | 458.828            | 462.508            | 0,05                      |
|   |             |                    | <b>14.899.818</b>  | <b>14.852.350</b>  | <b>1,53</b>               |
| <b>Curaçao</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Portigon Finance Curacao NV 6.375% 00 - 09.10.20  | 15.000.000  | EUR                | 21.864.647         | 20.426.360         | 2,11                      |
|   |             |                    | <b>21.864.647</b>  | <b>20.426.360</b>  | <b>2,11</b>               |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Casino Guichard Perrachon SA 4.379% 10 - 08.02.17   | 1.700.000   | EUR                | 2.372.897          | 1.929.030          | 0,20                      |
| Credit Agricole Home Loan SFH SA 0,625% 14 - 28.11.22   | 1.000.000   | EUR                | 1.197.425          | 1.158.009          | 0,12                      |
| Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH 1,125% 14 - 06.02.19  | 800.000     | EUR                | 990.743            | 920.296            | 0,09                      |
| Electricite de France SA 3,875% 12 - 18.01.22   | 2.900.000   | EUR                | 4.032.166          | 3.829.965          | 0,39                      |
| France OAT 1,75% 14 - 25.11.24  | 11.000.000  | EUR                | 13.871.937         | 14.010.823         | 1,44                      |
| France OAT 3,00% 12 - 25.04.22  | 8.977.000   | EUR                | 11.940.251         | 11.895.256         | 1,23                      |
| France OAT 3,75% 09 - 25.10.19  | 49.500.000  | EUR                | 63.234.790         | 62.760.715         | 6,47                      |
| France OAT 4,25% 03 - 25.04.19  | 48.900.000  | EUR                | 62.204.029         | 61.662.944         | 6,36                      |
| France OAT 5,50% 98 - 25.04.29  | 2.486.000   | EUR                | 4.317.932          | 4.556.994          | 0,47                      |
| France OAT 5,75% 01 - 25.10.32  | 923.000     | EUR                | 1.756.716          | 1.869.816          | 0,19                      |
| France OAT 6,00% 94 - 25.10.25  | 185.000     | EUR                | 318.867            | 318.769            | 0,03                      |
| Orange SA 4,125% 11 - 14.09.21  | 500.000     | USD                | 523.720            | 551.045            | 0,06                      |
| Schneider Electric SE 2,50% 13 - 06.09.21   | 1.800.000   | EUR                | 2.306.886          | 2.234.750          | 0,23                      |
| Societe Des Autoroutes Paris-Rhin-Rhone 2,25% 14 - 16.01.20                                       | 2.000.000   | EUR                | 2.458.536          | 2.381.276          | 0,25                      |
| Transport et Infrastructures Gaz France SA 4.339% 11 - 07.07.21                                   | 800.000     | EUR                | 1.101.456          | 1.048.762          | 0,11                      |
|   |             |                    | <b>172.628.351</b> | <b>171.128.450</b> | <b>17,64</b>              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Deutsche Bundesrepublik 0.01 – 97 - 04.01.23  | 10.100.000  | EUR                | 11.371.195         | 11.438.829         | 1,18                      |
| Deutsche Hypothekenbank AG 2,50% 06 - 08.03.18  | 9.200.000   | CHF                | 9.931.437          | 9.899.963          | 1,02                      |
| KFW 5,75% 01 - 07.06.32   | 19.753.000  | GBP                | 43.668.229         | 41.356.607         | 4,26                      |
| Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale FRN 01 - 03.05.41  | 1.800.000   | EUR                | 1.807.129          | 1.360.382          | 0,14                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert   | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten                   | Marktwert                        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|--------------------|----------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |               |                    |                                  |                                  |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |               |                    |                                  |                                  |                           |
| <b>Deutschland (Fortsetzung)</b>  |               |                    |                                  |                                  |                           |
| Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale<br>6,25% 01 - 01.06.31                                   | 6.300.000     | EUR                | 10.882.611<br><b>77.660.601</b>  | 10.717.022<br><b>74.772.803</b>  | 1,11<br><b>7,71</b>       |
| <b>Irland</b>   |               |                    |                                  |                                  |                           |
| LBB Finance Ireland PLC FRN 00 - 21.07.20   | 1.350.000     | EUR                | 1.768.303                        | 1.444.740                        | 0,15                      |
| LBB Finance Ireland PLC FRN 99 - 31.03.19   | 5.000.000     | EUR                | 5.930.339<br><b>7.698.642</b>    | 4.804.856<br><b>6.249.596</b>    | 0,49<br><b>0,64</b>       |
| <b>Italien</b>  |               |                    |                                  |                                  |                           |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,50%<br>12 - 20.03.17  | 18.700.000    | EUR                | 24.887.834                       | 21.234.499                       | 2,19                      |
| Enel SpA 5,25% 07 - 20.06.17  | 115.000       | EUR                | 146.188                          | 134.219                          | 0,01                      |
| Intesa Sanpaolo SpA 3,75% 12 - 25.09.19   | 1.000.000     | EUR                | 1.322.488                        | 1.247.168                        | 0,13                      |
| Intesa Sanpaolo SpA 4,375% 12 - 15.10.19  | 1.000.000     | EUR                | 1.316.855                        | 1.239.865                        | 0,13                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 07 -<br>01.02.18  | 1.750.000     | EUR                | 2.093.323                        | 2.084.567                        | 0,21                      |
| Region of Umbria Italy 6.063% 00 - 31.12.19   | 16.462.809    | EUR                | 19.654.668<br><b>49.421.356</b>  | 19.362.201<br><b>45.302.519</b>  | 2,00<br><b>4,67</b>       |
| <b>Japan</b>  |               |                    |                                  |                                  |                           |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 15 -<br>20.12.20  | 1.200.000.000 | JPY                | 10.702.480                       | 11.911.219                       | 1,23                      |
| Japan Government Five Year Bond 0,20% 12 -<br>20.06.17  | 5.403.300.000 | JPY                | 50.197.485                       | 52.921.687                       | 5,45                      |
| Japan Government Five Year Bond 0,30% 11 -<br>20.09.16  | 4.900.000.000 | JPY                | 43.671.231                       | 47.816.912                       | 4,93                      |
| Japan Government Forty Year Bond 0,40% 16<br>- 20.03.56   | 90.000.000    | JPY                | 858.085                          | 962.804                          | 0,10                      |
| Japan Government Forty Year Bond 1,90% 13<br>- 20.03.53   | 510.000.000   | JPY                | 7.004.000                        | 8.094.131                        | 0,83                      |
| Japan Government Ten Year Bond 0,60% 13 -<br>20.09.23   | 2.500.000.000 | JPY                | 21.517.452                       | 26.014.719                       | 2,68                      |
| Japan Government Thirty Year Bond 2,50% 08<br>- 20.03.38  | 830.000.000   | JPY                | 11.051.789                       | 12.268.531                       | 1,26                      |
| Japan Government Twenty Year Bond 1,60%<br>13 - 20.12.33  | 600.000.000   | JPY                | 6.799.499                        | 7.484.999                        | 0,77                      |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,00%<br>11 - 20.12.30  | 500.000.000   | JPY                | 4.926.197                        | 6.370.796                        | 0,66                      |
| Japan Government Twenty Year Bond 2,10%<br>07 - 20.12.27  | 1.400.000.000 | JPY                | 15.681.005                       | 17.269.714                       | 1,78                      |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 -<br>15.04.17   | 3.600.000.000 | JPY                | 32.339.643                       | 35.205.186                       | 3,63                      |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 -<br>15.05.17   | 1.000.000.000 | JPY                | 9.346.617                        | 9.782.922                        | 1,01                      |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 -<br>15.07.17   | 600.000.000   | JPY                | 5.407.132                        | 5.874.257                        | 0,61                      |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 -<br>15.09.17   | 2.600.000.000 | JPY                | 21.607.836                       | 25.467.024                       | 2,62                      |
| Japan Government Two Year Bond 0,10% 15 -<br>15.12.17   | 3.500.000.000 | JPY                | 28.732.738<br><b>269.843.189</b> | 34.316.649<br><b>301.761.550</b> | 3,54<br><b>31,10</b>      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten    | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Commerzbank Finance & Covered Bond SA<br>FRN 07 - 20.03.17  | 7.000.000   | USD                | 6.775.340         | 6.904.660         | 0,71                      |
| Nestle Finance International Ltd. 1,75% 12 -<br>12.09.22  | 800.000     | EUR                | 933.267           | 978.351           | 0,10                      |
|   |             |                    | <b>7.708.607</b>  | <b>7.883.011</b>  | <b>0,81</b>               |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Cooperatieve Rabobank UA 2,375% 13 -<br>22.05.23  | 2.000.000   | EUR                | 2.543.294         | 2.485.906         | 0,26                      |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,125% 10 -<br>14.01.20  | 1.070.000   | EUR                | 1.428.425         | 1.354.475         | 0,14                      |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,125% 11 -<br>12.01.21  | 1.000.000   | EUR                | 1.366.031         | 1.303.067         | 0,13                      |
| EnBW International Finance BV 4,875% 04 -<br>16.01.25   | 1.100.000   | EUR                | 1.693.392         | 1.640.812         | 0,17                      |
| Iberdrola International BV 4,50% 12 - 21.09.17  | 3.400.000   | EUR                | 4.298.474         | 3.983.389         | 0,41                      |
| Netherlands Zero Coupon – 93 - 15.01.20   | 2.509.000   | EUR                | 2.855.610         | 2.828.458         | 0,29                      |
| Netherlands 3,25% 11 - 15.07.21   | 4.540.000   | EUR                | 6.074.303         | 5.998.905         | 0,62                      |
| Netherlands 3,50% 10 - 15.07.20   | 3.276.000   | EUR                | 4.340.920         | 4.241.589         | 0,44                      |
| Netherlands 5,50% 98 - 15.01.28   | 300.000     | EUR                | 520.384           | 541.100           | 0,05                      |
| RWE Finance BV 6,50% 09 - 10.08.21  | 1.760.000   | EUR                | 2.427.763         | 2.501.402         | 0,26                      |
|   |             |                    | <b>27.548.596</b> | <b>26.879.103</b> | <b>2,77</b>               |
| <b>Norwegen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Statoil ASA 0,875% 15 - 17.02.23  | 1.500.000   | EUR                | 1.721.880         | 1.712.780         | 0,18                      |
| Statoil ASA 2,00% 13 - 10.09.20   | 2.000.000   | EUR                | 2.466.724         | 2.407.535         | 0,25                      |
| Telenor ASA 2,50% 13 - 22.05.25   | 650.000     | EUR                | 848.639           | 821.525           | 0,08                      |
|   |             |                    | <b>5.037.243</b>  | <b>4.941.840</b>  | <b>0,51</b>               |
| <b>Slowakei</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Slovakia 1,375% 13 - 16.10.19   | 1.225.000   | CHF                | 1.351.835         | 1.332.235         | 0,14                      |
|   |             |                    | <b>1.351.835</b>  | <b>1.332.235</b>  | <b>0,14</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Gas Natural Capital Markets SA 4,125% 10 -<br>26.01.18  | 1.700.000   | EUR                | 2.147.822         | 2.008.617         | 0,21                      |
| Spain Zero Coupon – 98 - 31.01.20   | 2.500.000   | EUR                | 2.784.197         | 2.755.043         | 0,29                      |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.29   | 1.900.000   | EUR                | 1.616.625         | 1.671.166         | 0,17                      |
| Spain Zero Coupon – 05 - 31.01.30   | 1.700.000   | EUR                | 1.430.124         | 1.482.109         | 0,15                      |
| Spain 1,95% 15 - 30.07.30   | 1.574.000   | EUR                | 1.739.828         | 1.831.590         | 0,19                      |
| Spain 5,15% 13 - 31.10.44   | 8.500.000   | EUR                | 13.417.268        | 15.133.632        | 1,56                      |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 8.400.000   | EUR                | 13.795.856        | 14.165.994        | 1,46                      |
|   |             |                    | <b>36.931.720</b> | <b>39.048.151</b> | <b>4,03</b>               |
| <b>Supranational</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| European Investment Bank 3,625% 12 -<br>14.03.42  | 1.500.000   | EUR                | 2.350.461         | 2.732.330         | 0,28                      |
| European Investment Bank 4,50% 09 -<br>15.10.25   | 13.200.000  | EUR                | 19.493.965        | 20.690.459        | 2,13                      |
| European Union 2,875% 12 - 04.04.28   | 2.084.000   | EUR                | 2.780.864         | 2.981.870         | 0,31                      |
|   |             |                    | <b>24.625.290</b> | <b>26.404.659</b> | <b>2,72</b>               |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Network Rail Infrastructure Finance PLC<br>2,75% 06 - 06.10.21                                    | 10.000.000  | CHF                | 12.863.475        | 12.184.972        | 1,26                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einkaufskosten     | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Santander UK PLC 4,375% 11 - 24.01.18   | 800.000     | EUR                | 1.075.219          | 950.248            | 0,10                      |
| Standard Chartered PLC 1,625% 13 - 20.11.18   | 3.135.000   | EUR                | 3.736.700          | 3.563.792          | 0,37                      |
| United Kingdom Gilt 3,25% 12 - 22.01.44   | 15.200.000  | GBP                | 27.128.100         | 26.998.976         | 2,78                      |
| United Kingdom Gilt 4,25% 06 - 07.12.46   | 31.500.000  | GBP                | 67.703.760         | 67.352.938         | 6,94                      |
| United Kingdom Gilt 4,75% 07 - 07.12.30   | 7.862.000   | GBP                | 15.346.777         | 15.187.971         | 1,56                      |
|   |             |                    | <b>127.854.031</b> | <b>126.238.897</b> | <b>13,01</b>              |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Apple Inc. 1,00% 14 - 10.11.22  | 1.400.000   | EUR                | 1.640.473          | 1.621.858          | 0,17                      |
| Citigroup Inc. 1,375% 14 - 27.10.21   | 1.400.000   | EUR                | 1.548.526          | 1.616.597          | 0,17                      |
| Citigroup Inc. 2,50% 13 - 26.09.18  | 2.234.000   | USD                | 2.254.441          | 2.278.278          | 0,24                      |
| General Electric Co. 4,125% 12 - 09.10.42   | 510.000     | USD                | 500.208            | 560.963            | 0,06                      |
| General Electric Co. 4,65% 11 - 17.10.21  | 2.340.000   | USD                | 2.580.622          | 2.679.705          | 0,28                      |
| Goldman Sachs Group Inc. 5,375% 10 - 15.03.20   | 2.128.000   | USD                | 2.380.998          | 2.367.015          | 0,24                      |
| Morgan Stanley 5,625% 09 - 23.09.19   | 1.702.000   | USD                | 1.924.366          | 1.888.382          | 0,19                      |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 11 - 15.07.21                                       | 12.079.793  | USD                | 12.265.816         | 12.713.197         | 1,31                      |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,125% 09 - 15.01.19                                       | 12.702.108  | USD                | 13.483.508         | 13.626.644         | 1,40                      |
| Verizon Communications Inc. 4,15% 14 - 15.03.24   | 2.234.000   | USD                | 2.310.135          | 2.464.468          | 0,25                      |
|   |             |                    | <b>40.889.093</b>  | <b>41.817.107</b>  | <b>4,31</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>910.253.468</b> | <b>934.013.374</b> | <b>96,27</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>910.253.468</b> | <b>934.013.374</b> | <b>96,27</b>              |
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>     |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| UniCredit Bank Austria AG 7,25% 97 - 15.02.17   | 6.614.000   | USD                | 6.894.695          | 6.787.617          | 0,70                      |
|   |             |                    | <b>6.894.695</b>   | <b>6.787.617</b>   | <b>0,70</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon - 98 - 01.11.16   | 7.993.000   | EUR                | 9.023.262          | 8.881.417          | 0,91                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon - 02 - 01.02.27   | 716.000     | EUR                | 669.012            | 665.218            | 0,07                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,01 - 02 - 01.08.30  | 800.000     | EUR                | 653.031            | 679.128            | 0,07                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,01 - 03 - 01.02.34  | 1.500.000   | EUR                | 1.070.358          | 1.133.485          | 0,12                      |
|   |             |                    | <b>11.415.663</b>  | <b>11.359.248</b>  | <b>1,17</b>               |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                    |                    |                           |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,50% 11 - 11.01.21  | 462.000     | USD                | 505.585            | 512.525            | 0,05                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten               | Marktwert                     | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------------------|-------------------------------|---------------------------|
| <b>An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>         |             |                    |                               |                               |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                               |                               |                           |
| <b>Niederlande (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                               |                               |                           |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,625% 13 -<br>01.12.23  | 2.660.000   | USD                | 2.762.969<br><b>3.268.554</b> | 2.809.944<br><b>3.322.469</b> | 0,29<br><b>0,34</b>       |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>21.578.912</b>             | <b>21.469.334</b>             | <b>2,21</b>               |
| <b>Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b> |             |                    | <b>21.578.912</b>             | <b>21.469.334</b>             | <b>2,21</b>               |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>931.832.380</b>            | <b>955.482.708</b>            | <b>98,48</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                               | <b>963.046.007</b>            | <b>99,26</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten           | Marktwert                 | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                           |                           |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                           |                           |                           |
| <b>Australien</b>   |             |                    |                           |                           |                           |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd.<br>3,75% 10 - 10.03.17                                 | 110.000     | EUR                | 112.814<br><b>112.814</b> | 112.890<br><b>112.890</b> | 0,06<br><b>0,06</b>       |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                           |                           |                           |
| Raiffeisen Bank International AG 6,00% 13 -<br>16.10.23   | 200.000     | EUR                | 195.676                   | 195.362                   | 0,10                      |
| Sappi Papier Holding GmbH 3.375% 15 -<br>01.04.22   | 100.000     | EUR                | 93.287<br><b>288.963</b>  | 100.554<br><b>295.916</b> | 0,05<br><b>0,15</b>       |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                           |                           |                           |
| Belgium 2,60% 14 - 22.06.24   | 272.000     | EUR                | 315.583<br><b>315.583</b> | 329.796<br><b>329.796</b> | 0,17<br><b>0,17</b>       |
| <b>Bulgarien</b>  |             |                    |                           |                           |                           |
| Bulgarian Energy Holding EAD 4,25% 13 -<br>07.11.18   | 100.000     | EUR                | 98.125                    | 99.712                    | 0,05                      |
| Bulgarian Telecommunications Co. EAD<br>6.625% 13 - 15.11.18                                      | 200.000     | EUR                | 204.500<br><b>302.625</b> | 202.468<br><b>302.180</b> | 0,11<br><b>0,16</b>       |
| <b>Cayman-Inseln</b>  |             |                    |                           |                           |                           |
| Viridian Group FundCo II Ltd. 7,50% 15 -<br>01.03.20  | 200.000     | EUR                | 199.250<br><b>199.250</b> | 206.452<br><b>206.452</b> | 0,11<br><b>0,11</b>       |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                           |                           |                           |
| Stora Enso OYJ 5,00% 12 - 19.03.18  | 484.000     | EUR                | 531.795<br><b>531.795</b> | 517.561<br><b>517.561</b> | 0,27<br><b>0,27</b>       |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                           |                           |                           |
| Areva SA 3,125% 14 - 20.03.23   | 500.000     | EUR                | 408.505                   | 391.880                   | 0,20                      |
| Areva SA 3,875% 09 - 23.09.16   | 2.000.000   | EUR                | 2.077.500                 | 1.986.640                 | 1,02                      |
| Areva SA 4,375% 09 - 06.11.19   | 100.000     | EUR                | 100.375                   | 89.191                    | 0,05                      |
| Areva SA 4,625% 11 - 05.10.17   | 500.000     | EUR                | 506.250                   | 483.125                   | 0,25                      |
| Cerba European Lab SAS 7,00% 13 - 01.02.20  | 96.000      | EUR                | 99.840                    | 99.500                    | 0,05                      |
| Cie de Financement Foncier SA 2,00% 10 -<br>20.12.17  | 4.000.000   | CHF                | 3.770.732                 | 3.835.508                 | 1,97                      |
| CMA CGM SA 7,75% 15 - 15.01.21  | 540.000     | EUR                | 505.775                   | 408.596                   | 0,21                      |
| Crown European Holdings SA 3,375% 15 -<br>15.05.25  | 235.000     | EUR                | 218.844                   | 234.612                   | 0,12                      |
| Dry Mix Solutions Investissements SAS FRN<br>14 - 15.06.21  | 100.000     | EUR                | 99.221                    | 98.376                    | 0,05                      |
| Elis SA 3,00% 15 - 30.04.22   | 200.000     | EUR                | 191.986                   | 198.324                   | 0,10                      |
| Faurecia 3,125% 15 - 15.06.22   | 500.000     | EUR                | 482.500                   | 500.355                   | 0,26                      |
| France OAT 1,00% 14 - 25.05.19  | 700.000     | EUR                | 728.479                   | 730.800                   | 0,38                      |
| France OAT 2,50% 10 - 25.10.20  | 1.813.000   | EUR                | 2.023.182                 | 2.042.920                 | 1,05                      |
| France OAT 3,25% 11 - 25.10.21  | 13.027.000  | EUR                | 15.347.479                | 15.529.986                | 7,98                      |
| France OAT 3,50% 10 - 25.04.20  | 600.000     | EUR                | 688.528                   | 691.244                   | 0,36                      |
| France OAT 3,75% 09 - 25.10.19  | 500.000     | EUR                | 568.727                   | 570.635                   | 0,29                      |
| Italcementi Finance SA 6,125% 13 - 21.02.18   | 700.000     | EUR                | 782.250                   | 756.266                   | 0,39                      |
| Lafarge SA 5,50% 09 - 16.12.19  | 162.000     | EUR                | 192.208                   | 189.534                   | 0,10                      |
| Loxam SAS 7,00% 14 - 23.07.22   | 500.000     | EUR                | 504.375                   | 532.210                   | 0,27                      |
| Numericable-SFR SA 5,375% 14 - 15.05.22   | 82.000      | EUR                | 85.895                    | 83.114                    | 0,04                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Frankreich (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Numericable-SFR SA 5,625% 14 - 15.05.24   | 642.000     | EUR                | 678.299           | 646.456           | 0,33                      |
| Orange SA 3,875% 10 - 09.04.20  | 500.000     | EUR                | 581.750           | 570.813           | 0,29                      |
| Peugeot SA 5,625% 12 - 11.07.17   | 300.000     | EUR                | 325.500           | 315.828           | 0,16                      |
| Peugeot SA 6,50% 13 - 18.01.19  | 970.000     | EUR                | 1.136.112         | 1.105.606         | 0,57                      |
| Peugeot SA 7,375% 13 - 06.03.18   | 157.000     | EUR                | 177.017           | 174.262           | 0,09                      |
|   |             |                    | <b>32.281.329</b> | <b>32.265.781</b> | <b>16,58</b>              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Bundesobligation 0,25% 15 - 16.10.20  | 1.162.000   | EUR                | 1.191.548         | 1.204.657         | 0,62                      |
| Deutsche Bundesrepublik Zero Coupon – 97 - 04.07.24   | 4.000.000   | EUR                | 3.931.820         | 3.997.760         | 2,05                      |
| Deutsche Lufthansa AG 6,50% 09 - 07.07.16   | 100.000     | EUR                | 106.625           | 100.029           | 0,05                      |
| Deutsche Raststaetten Gruppe IV GmbH 6,75% 13 - 30.12.20  | 83.000      | EUR                | 90.885            | 87.374            | 0,04                      |
| Techem Energy Metering Service GmbH & Co. KG 7,875% 12 - 01.10.20                                 | 132.000     | EUR                | 141.900           | 138.720           | 0,07                      |
| ThyssenKrupp AG 1,75% 15 - 25.11.20   | 287.000     | EUR                | 282.537           | 282.207           | 0,15                      |
| ThyssenKrupp AG 3,125% 14 - 25.10.19  | 800.000     | EUR                | 828.989           | 829.232           | 0,43                      |
| ThyssenKrupp AG 4,00% 13 - 27.08.18   | 966.000     | EUR                | 1.037.736         | 1.013.575         | 0,52                      |
| ThyssenKrupp AG 4,375% 12 - 28.02.17  | 227.000     | EUR                | 238.290           | 231.765           | 0,12                      |
| Trionista Holdco GmbH 5,00% 13 - 30.04.20   | 200.000     | EUR                | 209.250           | 204.798           | 0,11                      |
| Trionista TopCo GmbH 6,875% 13 - 30.04.21   | 95.000      | EUR                | 100.700           | 99.889            | 0,05                      |
| Unitymedia Hessen GmbH & Co KG Via  |             |                    |                   |                   |                           |
| Unitymedia NRW GmbH 4,00% 14 - 15.01.25   | 189.000     | EUR                | 191.599           | 189.935           | 0,10                      |
| Unitymedia Hessen GmbH & Co KG Via  |             |                    |                   |                   |                           |
| Unitymedia NRW GmbH 5,50% 12 - 15.09.22   | 81.000      | EUR                | 86.765            | 85.248            | 0,04                      |
| Unitymedia Hessen GmbH & Co KG Via  |             |                    |                   |                   |                           |
| Unitymedia NRW GmbH 5,75% 12 - 15.01.23   | 59.940      | EUR                | 64.735            | 63.237            | 0,03                      |
| Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG Via   |             |                    |                   |                   |                           |
| Unitymedia NRW GmbH 5,125% 13 - 01.02.19  | 729.000     | EUR                | 768.912           | 761.543           | 0,39                      |
|   |             |                    | <b>9.272.291</b>  | <b>9.289.969</b>  | <b>4,77</b>               |
| <b>Ungarn</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| MOL Hungarian Oil & Gas PLC 5,875% 10 - 20.04.17  | 852.000     | EUR                | 918.030           | 888.099           | 0,46                      |
| OTP Bank PLC 5,27% 06 - 19.09.16  | 200.000     | EUR                | 205.875           | 201.278           | 0,10                      |
|   |             |                    | <b>1.123.905</b>  | <b>1.089.377</b>  | <b>0,56</b>               |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Allied Irish Banks PLC 2,75% 14 - 16.04.19  | 900.000     | EUR                | 949.909           | 946.575           | 0,49                      |
| Allied Irish Banks PLC 2,875% 13 - 28.11.16   | 200.000     | EUR                | 205.500           | 201.986           | 0,10                      |
| Ardagh Packaging Finance PLC Via Ardagh   |             |                    |                   |                   |                           |
| Holdings USA Inc. 4,25% 14 - 15.01.22   | 200.000     | EUR                | 203.577           | 203.584           | 0,11                      |
| Bank of Ireland 1,25% 15 - 09.04.20   | 800.000     | EUR                | 795.000           | 816.178           | 0,42                      |
| Gazprombank OJSC Via GPB Eurobond   |             |                    |                   |                   |                           |
| Finance PLC 3,984% 13 - 30.10.18  | 530.000     | EUR                | 505.487           | 550.749           | 0,28                      |
| Smurfit Kappa Acquisitions 4,125% 13 - 30.01.20   | 73.000      | EUR                | 79.935            | 79.576            | 0,04                      |
|   |             |                    | <b>2.739.408</b>  | <b>2.798.648</b>  | <b>1,44</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Autostrada Brescia Verona Vicenza Padova SpA 2,375% 15 - 20.03.20                                 | 109.000     | EUR                | 110.771           | 113.300           | 0,06                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Italien (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Banca Popolare di Milano Scarl 4,25% 14 - 30.01.19  | 200.000     | EUR                | 214.375           | 213.860           | 0,11                      |
| Banca Popolare di Vicenza 2,75% 15 - 20.03.20   | 200.000     | EUR                | 190.500           | 171.602           | 0,09                      |
| Banca Popolare di Vicenza 3,50% 14 - 20.01.17   | 339.000     | EUR                | 345.549           | 331.216           | 0,17                      |
| Banco Popolare SC 2,375% 14 - 22.01.18  | 700.000     | EUR                | 709.240           | 706.034           | 0,36                      |
| Banco Popolare SC 3,50% 14 - 14.03.19   | 1.798.000   | EUR                | 1.865.009         | 1.843.166         | 0,95                      |
| Banco Popolare SC 6,00% 10 - 05.11.20   | 100.000     | EUR                | 109.218           | 102.318           | 0,05                      |
| Credito Emiliano SpA 1,875% 14 - 27.02.19   | 500.000     | EUR                | 533.415           | 525.212           | 0,27                      |
| Iccrea Banca SpA 1,875% 14 - 25.11.19   | 200.000     | EUR                | 201.750           | 204.284           | 0,11                      |
| Intesa Sanpaolo SpA 4,375% 12 - 15.10.19  | 500.000     | EUR                | 560.150           | 558.020           | 0,29                      |
| Intesa Sanpaolo SpA 6,625% 08 - 08.05.18  | 600.000     | EUR                | 657.750           | 640.926           | 0,33                      |
| Intesa Sanpaolo SpA 6,625% 13 - 13.09.23  | 380.000     | EUR                | 460.750           | 440.941           | 0,23                      |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro 0,01% 16 - 30.12.16   | 29.800.000  | EUR                | 29.800.593        | 29.785.100        | 15,31                     |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,70% 15 - 01.05.20   | 4.300.000   | EUR                | 4.379.084         | 4.393.765         | 2,26                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,00% 03 - 01.08.34   | 2.500.000   | EUR                | 3.584.148         | 3.667.175         | 1,88                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,25% 98 - 01.11.29   | 2.700.000   | EUR                | 3.759.841         | 3.864.672         | 1,99                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,00% 93 - 01.11.23   | 3.500.000   | EUR                | 5.478.045         | 5.514.327         | 2,83                      |
| Leonardo-Finmeccanica SpA 4,375% 12 - 05.12.17  | 1.000.000   | EUR                | 1.062.000         | 1.048.450         | 0,54                      |
| Leonardo-Finmeccanica SpA 4,50% 13 - 19.01.21   | 343.000     | EUR                | 380.721           | 378.219           | 0,19                      |
| Mediobanca SpA 1,125% 14 - 17.06.19   | 500.000     | EUR                | 520.785           | 516.515           | 0,27                      |
| Telecom Italia SpA 3,25% 15 - 16.01.23  | 393.000     | EUR                | 404.790           | 417.916           | 0,21                      |
| Telecom Italia SpA 4,00% 12 - 21.01.20  | 800.000     | EUR                | 879.746           | 873.000           | 0,45                      |
| Telecom Italia SpA 4,75% 11 - 25.05.18  | 800.000     | EUR                | 868.000           | 861.456           | 0,44                      |
| Telecom Italia SpA 6,125% 12 - 14.12.18   | 280.000     | EUR                | 317.800           | 316.445           | 0,16                      |
| Telecom Italia SpA 7,00% 11 - 20.01.17  | 400.000     | EUR                | 431.500           | 414.516           | 0,21                      |
| UniCredit SpA 4,25% 09 - 29.07.16   | 700.000     | EUR                | 737.310           | 701.925           | 0,36                      |
| UniCredit SpA 5,75% 07 - 26.09.17   | 541.000     | EUR                | 596.348           | 568.910           | 0,29                      |
| UniCredit SpA FRN 13 - 28.10.25   | 600.000     | EUR                | 681.750           | 622.194           | 0,32                      |
| UniCredit SpA 6,70% 08 - 05.06.18   | 200.000     | EUR                | 212.615           | 215.392           | 0,11                      |
| Unipol Gruppo Finanziario SpA 3,00% 15 - 18.03.25   | 300.000     | EUR                | 302.250           | 285.918           | 0,15                      |
|   |             |                    | <b>60.355.803</b> | <b>60.296.774</b> | <b>30,99</b>              |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Japan Government Ten Year Bond 0,30% 15 - 20.12.24  | 950.000.000 | JPY                | 6.981.925         | 8.759.211         | 4,50                      |
| Japan Government Twenty Year Bond 1,90% 10 - 20.09.30   | 242.150.000 | JPY                | 2.316.419         | 2.737.194         | 1,41                      |
| SoftBank Group Corp.  | 500.000     | EUR                | 516.250           | 527.925           | 0,27                      |
|   |             |                    | <b>9.814.594</b>  | <b>12.024.330</b> | <b>6,18</b>               |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten | Marktwert | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-----------------|-----------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                 |           |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                 |           |                           |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                 |           |                           |
| Altice Financing SA 5,25% 15 - 15.02.23   | 500.000     | EUR                | 507.488         | 504.515   | 0,26                      |
| Altice Luxembourg SA 7,25% 14 - 15.05.22  | 380.000     | EUR                | 393.390         | 382.516   | 0,20                      |
| ArcelorMittal 3,00% 14 - 25.03.19   | 570.000     | EUR                | 586.387         | 580.146   | 0,30                      |
| ArcelorMittal 3,00% 15 - 09.04.21   | 800.000     | EUR                | 795.000         | 777.736   | 0,40                      |
| ArcelorMittal 5,75% 12 - 29.03.18   | 1.200.000   | EUR                | 1.309.500       | 1.278.444 | 0,66                      |
| ArcelorMittal 5,875% 10 - 17.11.17  | 593.000     | EUR                | 573.990         | 629.084   | 0,32                      |
| Cirsa Funding Luxembourg SA 5.875% 15 - 15.05.23  | 400.000     | EUR                | 379.750         | 402.624   | 0,21                      |
| CNH Industrial Finance Europe SA 2,75% 14 - 18.03.19  | 100.000     | EUR                | 103.125         | 102.237   | 0,05                      |
| CNH Industrial Finance Europe SA 2,875% 14 - 27.09.21   | 700.000     | EUR                | 710.500         | 715.169   | 0,37                      |
| CNH Industrial Finance Europe SA 6,25% 11 - 09.03.18  | 432.000     | EUR                | 469.820         | 464.776   | 0,24                      |
| Dufry Finance SCA 4,50% 15 - 01.08.23   | 218.000     | EUR                | 226.175         | 227.888   | 0,12                      |
| Fiat Chrysler Finance Europe 4,75% 14 - 15.07.22  | 701.000     | EUR                | 746.851         | 750.869   | 0,39                      |
| Fiat Chrysler Finance Europe 6,625% 13 - 15.03.18   | 600.000     | EUR                | 663.375         | 642.306   | 0,33                      |
| Fiat Chrysler Finance Europe 6,75% 13 - 14.10.19  | 149.000     | EUR                | 170.233         | 167.294   | 0,09                      |
| Fiat Chrysler Finance Europe 7,00% 12 - 23.03.17  | 740.000     | EUR                | 811.225         | 768.675   | 0,39                      |
| FMC Finance VII SA 5,25% 11 - 15.02.21  | 90.000      | EUR                | 103.838         | 105.202   | 0,05                      |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 3,70% 13 - 25.07.18  | 1.200.000   | EUR                | 1.176.000       | 1.246.248 | 0,64                      |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 3,755% 12 - 15.03.17   | 1.481.000   | EUR                | 1.491.807       | 1.504.474 | 0,77                      |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 6.605% 07 - 13.02.18   | 1.150.000   | EUR                | 1.233.625       | 1.239.436 | 0,64                      |
| HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 2,25% 14 - 12.03.19  | 97.000      | EUR                | 100.741         | 99.745    | 0,05                      |
| HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 5.625% 07 - 04.01.18                                       | 732.000     | EUR                | 801.540         | 784.484   | 0,40                      |
| HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 7,50% 10 - 03.04.20  | 100.000     | EUR                | 128.250         | 122.836   | 0,06                      |
| HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 8,00% 09 - 31.01.17  | 900.000     | EUR                | 1.005.991       | 937.035   | 0,48                      |
| HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 9,50% 11 - 15.12.18  | 500.000     | EUR                | 644.375         | 604.680   | 0,31                      |
| INEOS Group Holdings SA 5,75% 14 - 15.02.19   | 600.000     | EUR                | 612.750         | 603.636   | 0,31                      |
| INEOS Group Holdings SA 6,50% 13 - 15.08.18   | 1.100.000   | EUR                | 1.114.250       | 1.112.045 | 0,57                      |
| Intralot Finance Luxembourg SA 9,75% 13 - 15.08.18  | 200.000     | EUR                | 208.202         | 208.770   | 0,11                      |
| Matterhorn Telecom SA FRN 15 - 01.05.22   | 40.000      | EUR                | 37.153          | 38.581    | 0,02                      |
| Play Finance 2 SA 5,25% 14 - 01.02.19   | 600.000     | EUR                | 615.750         | 612.750   | 0,31                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Luxemburg (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| SIG Combibloc Holdings SCA 7,75% 15 - 15.02.23  | 200.000     | EUR                | 210.750           | 210.566           | 0,11                      |
| Telenet Finance V Luxembourg SCA 6,25% 12 - 15.08.22  | 1.000       | EUR                | 1.054             | 1.068             | 0,00                      |
| Trinseo Materials Operating SCA Via Trinseo Materials Finance Inc. 6.375% 15 - 01.05.22           | 100.000     | EUR                | 93.046            | 100.227           | 0,05                      |
| Wind Acquisition Finance SA FRN 14 - 15.07.20   | 500.000     | EUR                | 499.675           | 484.360           | 0,25                      |
| Wind Acquisition Finance SA 4,00% 14 - 15.07.20   | 78.000      | EUR                | 78.984            | 76.931            | 0,04                      |
|   |             |                    | <b>18.604.590</b> | <b>18.487.353</b> | <b>9,50</b>               |
| <b>Mexiko</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Cemex SAB de CV 4,75% 14 - 11.01.22   | 100.000     | EUR                | 100.000           | 99.978            | 0,05                      |
|   |             |                    | <b>100.000</b>    | <b>99.978</b>     | <b>0,05</b>               |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Allianz Finance II BV FRN 05 - 29.12.49   | 300.000     | EUR                | 306.569           | 303.108           | 0,16                      |
| Bank Nederlandse Gemeenten NV 2,25% 05 - 14.10.20   | 1.200.000   | CHF                | 1.244.550         | 1.251.738         | 0,64                      |
| Darling Global Finance BV 4,75% 15 - 30.05.22   | 94.000      | EUR                | 87.949            | 94.996            | 0,05                      |
| Fresenius Finance BV 2,875% 13 - 15.07.20   | 91.000      | EUR                | 96.514            | 97.458            | 0,05                      |
| Fresenius Finance BV 3,00% 14 - 01.02.21  | 500.000     | EUR                | 545.625           | 536.885           | 0,28                      |
| Fresenius Finance BV 4,00% 14 - 01.02.24  | 82.000      | EUR                | 91.840            | 95.938            | 0,05                      |
| Fresenius Finance BV 4,25% 12 - 15.04.19  | 600.000     | EUR                | 669.750           | 656.418           | 0,34                      |
| General Motors Financial International BV 0,85% 15 - 23.02.18                                     | 800.000     | EUR                | 795.000           | 805.788           | 0,41                      |
| Grupo Isolux Corsan Finance BV 6.625% 14 - 15.04.21   | 200.000     | EUR                | 166.750           | 31.000            | 0,02                      |
| LGE HoldCo VI BV 7.125% 14 - 15.05.24   | 500.000     | EUR                | 565.063           | 551.250           | 0,28                      |
| Netherlands 0.01 – 93 - 15.01.20  | 500.000     | EUR                | 504.658           | 507.370           | 0,26                      |
| Netherlands 0,25% 14 - 15.01.20   | 1.694.000   | EUR                | 1.728.927         | 1.743.133         | 0,90                      |
| Netherlands 1,75% 13 - 15.07.23   | 1.324.000   | EUR                | 1.453.474         | 1.514.421         | 0,78                      |
| Netherlands 2,75% 14 - 15.01.47   | 4.471.000   | EUR                | 6.318.641         | 7.322.087         | 3,76                      |
| Nyrstar Netherlands Holdings BV 8,50% 14 - 15.09.19   | 200.000     | EUR                | 171.750           | 200.810           | 0,10                      |
| Petrobras Global Finance BV 2,75% 14 - 15.01.18   | 3.150.000   | EUR                | 2.778.212         | 3.059.501         | 1,57                      |
| Petrobras Global Finance BV 4,875% 11 - 07.03.18  | 1.220.000   | EUR                | 1.216.950         | 1.215.328         | 0,62                      |
| Schaeffler Finance BV 2,75% 14 - 15.05.19   | 270.000     | EUR                | 273.375           | 272.233           | 0,14                      |
| Schaeffler Finance BV 3,25% 15 - 15.05.25   | 116.000     | EUR                | 115.855           | 118.641           | 0,06                      |
| Schaeffler Finance BV 3,50% 14 - 15.05.22   | 270.000     | EUR                | 274.725           | 275.640           | 0,14                      |
| Schaeffler Finance BV 4,25% 13 - 15.05.18   | 681.000     | EUR                | 695.304           | 688.600           | 0,35                      |
| Univeg Holding BV 7.875% 13 - 15.11.20  | 100.000     | EUR                | 103.000           | 103.504           | 0,05                      |
| UPC Holding BV 6.375% 12 - 15.09.22   | 416.000     | EUR                | 448.760           | 439.941           | 0,23                      |
| Ziggo Secured Finance BV 3,75% 15 - 15.01.25  | 55.000      | EUR                | 51.820            | 53.556            | 0,03                      |
|   |             |                    | <b>20.705.061</b> | <b>21.939.344</b> | <b>11,27</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Norwegen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Lock AS 7,00% 14 - 15.08.21   | 100.000     | EUR                | 107.125           | 101.256           | 0,05                      |
|   |             |                    | <b>107.125</b>    | <b>101.256</b>    | <b>0,05</b>               |
| <b>Portugal</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Banco Comercial Portugues SA 3.375% 14 - 27.02.17   | 100.000     | EUR                | 100.687           | 97.314            | 0,05                      |
|   |             |                    | <b>100.687</b>    | <b>97.314</b>     | <b>0,05</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Bankia SA 3,50% 14 - 17.01.19   | 700.000     | EUR                | 756.955           | 743.750           | 0,38                      |
| BPE Financiaciones SA 2,50% 14 - 01.02.17   | 700.000     | EUR                | 712.250           | 707.756           | 0,36                      |
| Obrascon Huarte Lain SA 4,75% 14 - 15.03.22   | 200.000     | EUR                | 193.000           | 133.698           | 0,07                      |
| Spain Zero Coupon – 12 - 31.10.16   | 8.000.000   | EUR                | 8.001.813         | 8.004.880         | 4,11                      |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.27   | 1.700.000   | EUR                | 1.341.122         | 1.414.077         | 0,73                      |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.28   | 1.700.000   | EUR                | 1.304.049         | 1.378.700         | 0,71                      |
| Spain Zero Coupon – 01 - 30.07.30   | 1.700.000   | EUR                | 1.220.090         | 1.310.615         | 0,67                      |
| Spain 0.01 – 01 - 30.07.17  | 3.700.000   | EUR                | 3.695.008         | 3.703.663         | 1,90                      |
| Spain 0,75% 16 - 30.07.21   | 900.000     | EUR                | 909.565           | 922.900           | 0,48                      |
| Spain 4,60% 09 - 30.07.19   | 1.300.000   | EUR                | 1.479.756         | 1.484.542         | 0,76                      |
| Spain 4,85% 10 - 31.10.20   | 300.000     | EUR                | 357.327           | 361.327           | 0,19                      |
|   |             |                    | <b>19.970.935</b> | <b>20.165.908</b> | <b>10,36</b>              |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Alliance Automotive Finance PLC 6,25% 14 - 01.12.21   | 65.000      | EUR                | 68.737            | 68.491            | 0,04                      |
| Anglo American Capital PLC 1,75% 14 - 03.04.18  | 211.000     | EUR                | 200.391           | 207.504           | 0,11                      |
| Anglo American Capital PLC 2,50% 12 - 18.09.18  | 1.000.000   | EUR                | 955.889           | 988.520           | 0,51                      |
| AstraZeneca PLC 0,875% 14 - 24.11.21  | 1.100.000   | EUR                | 1.118.866         | 1.134.422         | 0,58                      |
| Iglo Foods BondCo PLC FRN 14 - 15.06.20   | 100.000     | EUR                | 99.745            | 97.726            | 0,05                      |
| International Game Technology PLC 4,125% 15 - 15.02.20  | 608.000     | EUR                | 611.040           | 633.840           | 0,33                      |
| International Game Technology PLC 4,75% 15 - 15.02.23   | 64.000      | EUR                | 63.103            | 66.240            | 0,03                      |
| International Game Technology PLC 6,625% 10 - 02.02.18  | 200.000     | EUR                | 219.625           | 216.000           | 0,11                      |
| OTE PLC 7.875% 13 - 07.02.18  | 109.000     | EUR                | 111.647           | 115.745           | 0,06                      |
| Royal Bank of Scotland PLC 4,35% 06 - 23.01.17  | 1.100.000   | EUR                | 1.135.750         | 1.116.665         | 0,57                      |
| Royal Bank of Scotland PLC 6.934% 08 - 09.04.18   | 1.700.000   | EUR                | 1.880.625         | 1.836.000         | 0,94                      |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 1.375% 14 - 01.07.19  | 42.000      | EUR                | 40.827            | 41.449            | 0,02                      |
| Tesco PLC 3.375% 11 - 02.11.18  | 1.400.000   | EUR                | 1.454.750         | 1.468.264         | 0,75                      |
| Tesco PLC 5.875% 08 - 12.09.16  | 50.000      | EUR                | 52.313            | 50.464            | 0,03                      |
| Virgin Media Finance PLC 4,50% 15 - 15.01.25  | 200.000     | EUR                | 198.000           | 192.774           | 0,10                      |
|   |             |                    | <b>8.211.308</b>  | <b>8.234.104</b>  | <b>4,23</b>               |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Apple Inc. 3,05% 15 - 31.07.29  | 2.400.000   | GBP                | 3.101.243         | 3.069.569         | 1,58                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten    | Marktwert          | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                    |                    |                           |
| Celanese US Holdings LLC 3,25% 14 -<br>15.10.19   | 55.000      | EUR                | 56.513             | 57.819             | 0,03                      |
| Cemex Finance LLC 5,25% 14 - 01.04.21   | 110.000     | EUR                | 113.712            | 112.517            | 0,06                      |
| Fiat Chrysler Finance North America Inc.<br>5.625% 07 - 12.06.17  | 1.000.000   | EUR                | 1.057.500          | 1.037.500          | 0,53                      |
| ZF North America Capital Inc. 2,25% 15 -<br>26.04.19  | 500.000     | EUR                | 500.577            | 512.500            | 0,26                      |
|   |             |                    | <b>4.829.545</b>   | <b>4.789.905</b>   | <b>2,46</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>189.967.611</b> | <b>193.444.836</b> | <b>99,41</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>189.967.611</b> | <b>193.444.836</b> | <b>99,41</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>189.967.611</b> | <b>193.444.836</b> | <b>99,41</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                    | <b>195.445.316</b> | <b>100,44</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND SHORT DAILY UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016

(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Belgium 4,25% 11 - 28.09.21   | 217.000     | EUR                | 265.847          | 270.482          | 7,94                      |
| Belgium 4,25% 10 - 28.03.41   | 520.000     | EUR                | 816.195          | 919.123          | 26,99                     |
|   |             |                    | <b>1.082.042</b> | <b>1.189.605</b> | <b>34,93</b>              |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat SA<br>3,60% 11 - 13.09.21  | 70.000      | EUR                | 84.999           | 83.687           | 2,46                      |
| France OAT Zero Coupon – 15 - 25.02.18  | 300.000     | EUR                | 302.013          | 302.743          | 8,89                      |
| France OAT 2,75% 12 - 25.10.27  | 201.000     | EUR                | 236.536          | 256.058          | 7,52                      |
| France OAT 3,75% 05 - 25.04.21  | 76.000      | EUR                | 92.260           | 91.240           | 2,68                      |
|   |             |                    | <b>715.808</b>   | <b>733.728</b>   | <b>21,55</b>              |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Japan Government Ten Year Bond 0,30% 15 -<br>20.12.24   | 10.000.000  | JPY                | 73.494           | 92.202           | 2,71                      |
|   |             |                    | <b>73.494</b>    | <b>92.202</b>    | <b>2,71</b>               |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Netherlands 3,50% 10 - 15.07.20   | 293.000     | EUR                | 337.069          | 341.474          | 10,03                     |
|   |             |                    | <b>337.069</b>   | <b>341.474</b>   | <b>10,03</b>              |
| <b>Slowenien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Slovenia 5,85% 13 - 10.05.23  | 332.000     | USD                | 348.651          | 347.169          | 10,20                     |
|   |             |                    | <b>348.651</b>   | <b>347.169</b>   | <b>10,20</b>              |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Bankia SA 4,25% 06 - 25.05.18   | 50.000      | EUR                | 55.502           | 54.007           | 1,58                      |
| Spain 4,10% 08 - 30.07.18   | 300.000     | EUR                | 324.615          | 326.436          | 9,59                      |
| Spain 5,40% 13 - 31.01.23   | 212.000     | EUR                | 273.314          | 278.384          | 8,17                      |
| Spain 6,00% 98 - 31.01.29   | 100.000     | EUR                | 139.722          | 151.801          | 4,46                      |
|   |             |                    | <b>793.153</b>   | <b>810.628</b>   | <b>23,80</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>3.350.217</b> | <b>3.514.806</b> | <b>103,22</b>             |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>3.350.217</b> | <b>3.514.806</b> | <b>103,22</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>3.350.217</b> | <b>3.514.806</b> | <b>103,22</b>             |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                  | <b>3.564.981</b> | <b>104,69</b>             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF\*

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                  |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                  |                   |                           |
| <b>Österreich</b>   |             |                    |                  |                   |                           |
| Austria 3,40% 12 - 22.11.22   | 700.000     | EUR                | 857.273          | 866.594           | 1,25                      |
| Austria 4,35% 08 - 15.03.19   | 1.500.000   | EUR                | 1.694.361        | 1.697.616         | 2,45                      |
| Sappi Papier Holding GmbH 3.375% 15 - 01.04.22  | 200.000     | EUR                | 187.434          | 201.108           | 0,29                      |
|   |             |                    | <b>2.739.068</b> | <b>2.765.318</b>  | <b>3,99</b>               |
| <b>Belgien</b>  |             |                    |                  |                   |                           |
| Barry Callebaut Services NV 6,00% 07 - 13.07.17   | 500.000     | EUR                | 538.125          | 527.430           | 0,76                      |
| Belgium 4,00% 12 - 28.03.32   | 1.400.000   | EUR                | 1.974.751        | 2.134.776         | 3,08                      |
| Belgium 5,50% 98 - 28.03.28   | 2.500.000   | EUR                | 3.809.821        | 4.003.058         | 5,78                      |
|   |             |                    | <b>6.322.697</b> | <b>6.665.264</b>  | <b>9,62</b>               |
| <b>Brasilien</b>  |             |                    |                  |                   |                           |
| Banco do Brasil SA 3,75% 13 - 25.07.18  | 720.000     | EUR                | 706.364          | 719.568           | 1,04                      |
|   |             |                    | <b>706.364</b>   | <b>719.568</b>    | <b>1,04</b>               |
| <b>Finnland</b>   |             |                    |                  |                   |                           |
| Finland 3,375% 10 - 15.04.20  | 62.000      | EUR                | 71.118           | 71.179            | 0,11                      |
| Stora Enso OYJ 5,50% 12 - 07.03.19  | 500.000     | EUR                | 557.929          | 555.810           | 0,80                      |
|   |             |                    | <b>629.047</b>   | <b>626.989</b>    | <b>0,91</b>               |
| <b>Frankreich</b>   |             |                    |                  |                   |                           |
| Areva SA 3,875% 09 - 23.09.16   | 800.000     | EUR                | 828.000          | 794.656           | 1,15                      |
| Areva SA 4.625% 11 - 05.10.17   | 400.000     | EUR                | 405.686          | 386.500           | 0,56                      |
| Cie de Financement Foncier SA 2,375% 05 - 24.08.18  | 3.500.000   | CHF                | 3.399.576        | 3.446.198         | 4,97                      |
| Elis SA 3,00% 15 - 30.04.22   | 300.000     | EUR                | 287.422          | 297.486           | 0,43                      |
| Europcar Groupe SA 5,75% 15 - 15.06.22  | 150.000     | EUR                | 150.875          | 155.435           | 0,22                      |
| France OAT 2,50% 14 - 25.05.30  | 670.000     | EUR                | 744.618          | 857.819           | 1,24                      |
| France OAT 3,00% 12 - 25.04.22  | 3.000       | EUR                | 3.470            | 3.578             | 0,01                      |
| France OAT 3,75% 05 - 25.04.21  | 290.000     | EUR                | 344.671          | 348.152           | 0,50                      |
| France OAT 5,75% 01 - 25.10.32  | 800.000     | EUR                | 1.348.838        | 1.458.791         | 2,10                      |
| Holdikks SAS 6,75% 14 - 15.07.21  | 100.000     | EUR                | 94.008           | 95.121            | 0,14                      |
| Italcementi Finance SA 6.125% 13 - 21.02.18   | 500.000     | EUR                | 543.701          | 540.190           | 0,78                      |
| Numericable-SFR SA 5,375% 14 - 15.05.22   | 100.000     | EUR                | 102.097          | 101.359           | 0,15                      |
| Numericable-SFR SA 5.625% 14 - 15.05.24   | 100.000     | EUR                | 101.067          | 100.694           | 0,14                      |
| Peugeot SA 7,375% 13 - 06.03.18   | 1.220.000   | EUR                | 1.350.302        | 1.354.139         | 1,95                      |
| SPCM SA 2.875% 15 - 15.06.23  | 200.000     | EUR                | 187.517          | 191.640           | 0,28                      |
| Verallia Packaging SASU 5.125% 15 - 01.08.22  | 54.000      | EUR                | 54.820           | 55.289            | 0,08                      |
|   |             |                    | <b>9.946.668</b> | <b>10.187.047</b> | <b>14,70</b>              |
| <b>Deutschland</b>  |             |                    |                  |                   |                           |
| Bayerische Landesbank 6,00% 00 - 10.03.20   | 700.000     | EUR                | 847.763          | 826.546           | 1,19                      |
| Douglas GmbH 6,25% 15 - 15.07.22  | 100.000     | EUR                | 105.000          | 106.576           | 0,15                      |
| ThyssenKrupp AG 4,00% 13 - 27.08.18   | 500.000     | EUR                | 527.540          | 524.625           | 0,76                      |
|   |             |                    | <b>1.480.303</b> | <b>1.457.747</b>  | <b>2,10</b>               |
| <b>Island</b>   |             |                    |                  |                   |                           |
| Arion Banki HF 3.125% 15 - 12.03.18   | 800.000     | EUR                | 796.809          | 812.920           | 1,17                      |
|   |             |                    | <b>796.809</b>   | <b>812.920</b>    | <b>1,17</b>               |
| <b>Irland</b>   |             |                    |                  |                   |                           |
| Ireland 5,90% 09 - 18.10.19   | 400.000     | EUR                | 479.685          | 481.064           | 0,70                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Irland (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| Smurfit Kappa Acquisitions FRN 12 - 15.10.20  | 500.000     | EUR                | 517.282           | 526.580           | 0,76                      |
|   |             |                    | <b>996.967</b>    | <b>1.007.644</b>  | <b>1,46</b>               |
| <b>Italien</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Astaldi SpA 7.125% 13 - 01.12.20  | 136.000     | EUR                | 130.993           | 133.064           | 0,19                      |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,875%<br>14 - 16.04.21                                       | 400.000     | EUR                | 448.812           | 441.545           | 0,64                      |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625%<br>14 - 01.04.19                                       | 1.082.000   | EUR                | 1.066.132         | 1.076.298         | 1,56                      |
| Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC<br>3.375% 13 - 22.10.18                                     | 400.000     | EUR                | 444.944           | 431.409           | 0,62                      |
| Buzzi Unicem SpA 6,25% 12 - 28.09.18  | 500.000     | EUR                | 544.434           | 555.915           | 0,80                      |
| Intesa Sanpaolo SpA 6,625% 13 - 13.09.23  | 900.000     | EUR                | 1.064.966         | 1.044.333         | 1,51                      |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro Zero Coupon –<br>16 - 29.07.16                                    | 1.027.000   | EUR                | 1.027.041         | 1.027.175         | 1,48                      |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro 0.01 – 15 -<br>14.12.16   | 500.000     | EUR                | 500.188           | 500.400           | 0,72                      |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro 0.01 – 15 -<br>13.01.17   | 500.000     | EUR                | 500.274           | 500.400           | 0,72                      |
| Italy Buoni Ordinari Del Tesoro 0.01 – 16 -<br>14.04.21   | 500.000     | EUR                | 500.217           | 500.560           | 0,72                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 10 -<br>01.03.21  | 2.865.000   | EUR                | 3.293.317         | 3.323.661         | 4,80                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 13 -<br>01.05.21  | 1.690.000   | EUR                | 1.939.021         | 1.965.188         | 2,84                      |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 12 -<br>01.06.17  | 3.800.000   | EUR                | 3.970.809         | 3.971.167         | 5,73                      |
| Snam SpA 3.875% 12 - 19.03.18   | 223.000     | EUR                | 244.279           | 237.697           | 0,35                      |
| UniCredit SpA 6,95% 12 - 31.10.22   | 1.910.000   | EUR                | 2.203.200         | 2.155.932         | 3,11                      |
|   |             |                    | <b>17.878.627</b> | <b>17.864.744</b> | <b>25,79</b>              |
| <b>Japan</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Japan Government Five Year Bond 0,10% 15 -<br>20.12.20  | 700.000.000 | JPY                | 5.590.364         | 6.254.300         | 9,03                      |
| Japan Government Ten Year Bond 0,30% 15 -<br>20.12.24   | 470.000.000 | JPY                | 3.454.216         | 4.333.505         | 6,25                      |
|   |             |                    | <b>9.044.580</b>  | <b>10.587.805</b> | <b>15,28</b>              |
| <b>Luxemburg</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| Cirsa Funding Luxembourg SA 5.875% 15 -<br>15.05.23   | 100.000     | EUR                | 95.000            | 100.656           | 0,14                      |
| CNH Industrial Finance Europe SA 2,75% 14 -<br>18.03.19   | 500.000     | EUR                | 509.055           | 511.185           | 0,74                      |
| CNH Industrial Finance Europe SA 6,25% 11 -<br>09.03.18   | 140.000     | EUR                | 150.506           | 150.622           | 0,22                      |
| Fiat Chrysler Finance Europe 7,75% 12 -<br>17.10.16   | 119.000     | EUR                | 121.493           | 121.078           | 0,17                      |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 3,755% 12<br>- 15.03.17  | 1.000.000   | EUR                | 1.002.020         | 1.015.850         | 1,47                      |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 6.605% 07<br>- 13.02.18  | 400.000     | EUR                | 414.337           | 431.108           | 0,62                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten  | Marktwert        | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|------------------|------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| <b>Luxemburg (Fortsetzung)</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| HeidelbergCement Finance Luxembourg SA<br>8,00% 09 - 31.01.17                                     | 100.000     | EUR                | 104.586          | 104.115          | 0,15                      |
| Matterhorn Telecom SA 3.875% 15 - 01.05.22  | 200.000     | EUR                | 179.501          | 192.716          | 0,28                      |
| Telenet Finance V Luxembourg SCA 6,25% 12<br>- 15.08.22   | 200.000     | EUR                | 212.386          | 213.650          | 0,31                      |
| Trinseo Materials Operating SCA Via Trinseo<br>Materials Finance Inc. 6.375% 15 - 01.05.22        | 200.000     | EUR                | 191.381          | 200.454          | 0,29                      |
|   |             |                    | <b>2.980.265</b> | <b>3.041.434</b> | <b>4,39</b>               |
| <b>Mexiko</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| Petroleos Mexicanos 3,75% 14 - 16.04.26   | 1.400.000   | EUR                | 1.531.460        | 1.307.367        | 1,89                      |
|   |             |                    | <b>1.531.460</b> | <b>1.307.367</b> | <b>1,89</b>               |
| <b>Niederlande</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Enel Finance International NV 1,966% 15 -<br>27.01.25   | 500.000     | EUR                | 529.195          | 545.765          | 0,79                      |
| OI European Group BV 6,75% 10 - 15.09.20  | 147.000     | EUR                | 164.046          | 171.617          | 0,25                      |
| Portugal Telecom International Finance BV<br>4,625% 13 - 08.05.20                                 | 693.000     | EUR                | 219.132          | 103.957          | 0,15                      |
| Portugal Telecom International Finance BV<br>5.875% 12 - 17.04.18                                 | 900.000     | EUR                | 515.750          | 135.000          | 0,19                      |
| Repsol International Finance BV 2.625% 13 -<br>28.05.20   | 400.000     | EUR                | 433.424          | 430.015          | 0,62                      |
| Schaeffler Finance BV 3,25% 14 - 15.05.19   | 164.000     | EUR                | 166.255          | 165.794          | 0,24                      |
|   |             |                    | <b>2.027.802</b> | <b>1.552.148</b> | <b>2,24</b>               |
| <b>Spanien</b>  |             |                    |                  |                  |                           |
| Cellnex Telecom SAU 3.125% 15 - 27.07.22  | 200.000     | EUR                | 191.000          | 204.682          | 0,30                      |
| Ence Energia y Celulosa SA 5.375% 15 -<br>01.11.22  | 300.000     | EUR                | 308.297          | 315.921          | 0,46                      |
| Spain 1,60% 15 - 30.04.25   | 3.000.000   | EUR                | 3.075.733        | 3.159.540        | 4,56                      |
| Spain 4,80% 08 - 31.01.24   | 678.000     | EUR                | 828.950          | 876.167          | 1,26                      |
| Spain 5,75% 01 - 30.07.32   | 1.000.000   | EUR                | 1.554.590        | 1.574.566        | 2,27                      |
|   |             |                    | <b>5.958.570</b> | <b>6.130.876</b> | <b>8,85</b>               |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| Anglo American Capital PLC 2,50% 12 -<br>18.09.18   | 300.000     | EUR                | 297.226          | 296.556          | 0,43                      |
| OTE PLC 7.875% 13 - 07.02.18  | 720.000     | EUR                | 751.994          | 764.554          | 1,10                      |
| Synlab Bondco PLC 6,25% 15 - 01.07.22   | 100.000     | EUR                | 101.517          | 105.358          | 0,15                      |
| Tesco PLC 3.375% 11 - 02.11.18  | 300.000     | EUR                | 313.203          | 314.628          | 0,46                      |
| Thomas Cook Finance PLC 7,75% 13 -<br>15.06.20  | 310.000     | EUR                | 317.316          | 302.727          | 0,44                      |
|   |             |                    | <b>1.781.256</b> | <b>1.783.823</b> | <b>2,58</b>               |
| <b>Vereinigte Staaten</b>   |             |                    |                  |                  |                           |
| Belden Inc. 5,50% 13 - 15.04.23   | 91.000      | EUR                | 88.860           | 91.228           | 0,13                      |
| Chesapeake Energy Corp.   | 200.000     | EUR                | 146.305          | 186.080          | 0,27                      |
| MPT Operating Partnership LP Via MPT<br>Finance Corp.   | 91.000      | EUR                | 91.425           | 94.212           | 0,13                      |
| ZF North America Capital Inc. 2,25% 15 -<br>26.04.19  | 500.000     | EUR                | 511.484          | 512.500          | 0,74                      |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF\* (Fortsetzung)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in EUR)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>             |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| ZF North America Capital Inc. 2,75% 15 -<br>27.04.23  | 100.000     | EUR                | 95.125            | 102.640           | 0,15                      |
|   |             |                    | <b>933.199</b>    | <b>986.660</b>    | <b>1,42</b>               |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>65.753.682</b> | <b>67.497.354</b> | <b>97,43</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer<br/>offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>65.753.682</b> | <b>67.497.354</b> | <b>97,43</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>65.753.682</b> | <b>67.497.354</b> | <b>97,43</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER<br/>ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>68.345.074</b> | <b>98,65</b>              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

db x-trackers II\*\*

db x-trackers II HARVEST CSI CHINA SOVEREIGN BOND UCITS ETF (DR)

Anlagebestand zum 30. Juni 2016  
(Angaben in USD)

| Beschreibung  | Nominalwert | Währung<br>(lokal) | Einstandskosten   | Marktwert         | % des Netto-<br>vermögens |
|---|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b>         |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>Anleihen</b>   |             |                    |                   |                   |                           |
| <b>China</b>  |             |                    |                   |                   |                           |
| China 2,53% 16 - 14.01.21   | 20.000.000  | CNY                | 3.077.296         | 3.002.718         | 10,89                     |
| China 2,58% 16 - 17.03.23   | 20.000.000  | CNY                | 3.009.117         | 2.997.110         | 10,87                     |
| China 2,75% 16 - 15.08.20   | 50.000.000  | CNY                | 7.489.261         | 7.479.021         | 27,11                     |
| China 3,05% 15 - 22.10.22   | 10.000.000  | CNY                | 1.559.931         | 1.531.415         | 5,55                      |
| China 3,30% 15 - 09.07.22   | 40.000.000  | CNY                | 6.318.083         | 6.181.218         | 22,41                     |
| China 3,54% 15 - 16.04.22   | 30.000.000  | CNY                | 4.856.905         | 4.711.295         | 17,08                     |
|   |             |                    | <b>26.310.593</b> | <b>25.902.777</b> | <b>93,91</b>              |
| <b>Summe - Anleihen</b>   |             |                    | <b>26.310.593</b> | <b>25.902.777</b> | <b>93,91</b>              |
| <b>Summe - Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notieren</b> |             |                    | <b>26.310.593</b> | <b>25.902.777</b> | <b>93,91</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND</b>  |             |                    | <b>26.310.593</b> | <b>25.902.777</b> | <b>93,91</b>              |
| <b>SUMME ANLAGEBESTAND EINSCHLIESSLICH AUFGELAUFENER ZINSEN</b>   |             |                    |                   | <b>26.273.956</b> | <b>95,26</b>              |

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Der Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

## Anhang zum Halbjahresabschluss

**1. Allgemeines**

## a) Die Gesellschaft

db x-trackers II\*\* (die „Gesellschaft“) ist im Großherzogtum Luxemburg als Organismus für gemeinsame Anlagen gemäß Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (das „Gesetz“) eingetragen.

Die Gesellschaft wurde am 7. Februar 2007 als Investmentgesellschaft in der Rechtsform einer *Société d'investissement à capital variable* („SICAV“) nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg auf unbestimmte Zeit gegründet.

Die Satzung wurde beim luxemburgischen Handels- und Gesellschaftsregister („*Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg*“) hinterlegt und am 1. März 2007 im *Recueil des Sociétés et Associations des Großherzogtums Luxemburg* (der „*Mémorial*“) veröffentlicht. Die Satzung wurde zuletzt durch eine außerordentliche Hauptversammlung der Anteilhaber am 12. Mai 2014 geändert und das Protokoll dieser Versammlung wurde am 6. Juni 2014 im *Mémorial* veröffentlicht. Die Gesellschaft ist im luxemburgischen Handels- und Gesellschaftsregister unter der Nummer B-124.284 eingetragen.

Die Gesellschaft ist als Umbrella-Fonds strukturiert, um Anlegern die Möglichkeit zu geben, unter verschiedenen Anlageportfolios („Teilfonds“) zu wählen.

Alle Teilfonds der Gesellschaft sind Exchange Traded Funds („ETF“) und an den in den Fußnoten zu der nachfolgenden Tabelle angegebenen Börsen notiert.

Zum 30. Juni 2016 hat die Gesellschaft 65 aktive Teilfonds:

| Teilfonds  | Auflegungstermin |
|--|------------------|
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF <sup>*(1)(2)(3)(4)</sup>                | 22. Mai 2007     |
| db x-trackers II EONIA UCITS ETF <sup>*(1)(2)(3)(4)(5)(7)(9)</sup>                           | 25. Mai 2007     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                  | 25. Mai 2007     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                  | 25. Mai 2007     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                  | 30. Mai 2007     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                 | 30. Mai 2007     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                | 1. Juni 2007     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                  | 1. Juni 2007     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+ UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                  | 5. Juni 2007     |
| db x-trackers II IBOXX EURO INFLATION-LINKED UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                    | 8. Juni 2007     |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF <sup>*(1)(2)(4)(7)</sup>            | 8. Juni 2007     |
| db x-trackers II ITRAXX <sup>®</sup> CROSSOVER UCITS ETF <sup>*(2)(4)(5)</sup>               | 16. Juli 2007    |
| db x-trackers II ITRAXX <sup>®</sup> EUROPE UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                     | 16. Juli 2007    |
| db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE RATE UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                       | 10. Oktober 2007 |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                          | 10. Oktober 2007 |
| db x-trackers II STERLING CASH UCITS ETF <sup>*(1)(2)(4)</sup>                               | 10. Oktober 2007 |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS UCITS ETF <sup>*(1)(2)(4)(7)</sup>                            | 12. Oktober 2007 |
| db x-trackers II IBOXX UK GILT INFLATION-LINKED UCITS ETF <sup>*(1)(2)(4)(7)</sup>           | 12. Oktober 2007 |
| db x-trackers II ITRAXX <sup>®</sup> CROSSOVER SHORT DAILY UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>      | 7. November 2007 |
| db x-trackers II ITRAXX <sup>®</sup> EUROPE SHORT DAILY UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>         | 7. November 2007 |
| db x-trackers II EMERGING MARKETS LIQUID EUROBOND UCITS ETF <sup>*(2)(4)(5)</sup>            | 6. Mai 2008      |
| db x-trackers II SHORT IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE DAILY UCITS ETF <sup>*(2)(4)(7)</sup>     | 6. Mai 2008      |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF <sup>*(1)(2)(4)(7)</sup>                         | 20. Oktober 2008 |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF (DR) <sup>(1)(4)(7)</sup>                 | 7. Juli 2009     |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR) <sup>(1)(3)(4)(7)</sup> | 7. Juli 2009     |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR) <sup>(1)(3)(4)(5)(7)</sup>               | 7. Juli 2009     |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS 1-5 UCITS ETF <sup>*(1)(4)(7)</sup>                           | 7. Juli 2009     |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 1-3 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                              | 5. Januar 2010   |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF <sup>*(2)(4)(5)</sup>                               | 5. Januar 2010   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

**1. Allgemeines (Fortsetzung)**

## a) Die Gesellschaft (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Auflegungstermin   |
|--|--------------------|
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                       | 23. Februar 2010   |
| db x-trackers II SINGAPORE DOLLAR CASH UCITS ETF <sup>*(3)(4)(7)</sup>                         | 8. März 2010       |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF <sup>*(1)(2)(3)(4)(6)(7)</sup>               | 13. April 2010     |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF KOREA GOVERNMENT UCITS ETF <sup>*(3)(4)(7)</sup>             | 13. April 2010     |
| db x-trackers II UK GILTS SHORT DAILY UCITS ETF <sup>*(1)(4)(7)</sup>                          | 5. Mai 2010        |
| db x-trackers II US TREASURIES SHORT DAILY UCITS ETF <sup>*(1)(7)</sup>                        | 5. Mai 2010        |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF SINGAPORE GOVERNMENT UCITS ETF <sup>*(3)(4)(7)</sup>         | 11. Mai 2010       |
| db x-trackers II AUSTRALIA SSA BONDS UCITS ETF <sup>*(1)(2)(3)(4)(7)</sup>                     | 19. Mai 2010       |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                    | 22. September 2010 |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>             | 22. September 2010 |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>            | 18. Oktober 2010   |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>        | 18. Oktober 2010   |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED 1-3 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                        | 24. August 2011    |
| db x-trackers II ITRAXX <sup>®</sup> CROSSOVER 2X SHORT DAILY UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>     | 22. November 2011  |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BOT UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                         | 12. Januar 2012    |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY AGGREGATE UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                   | 12. Januar 2012    |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BTP UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                         | 12. Januar 2012    |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 3-5 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                                | 12. Januar 2012    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA 1-3 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                | 12. Januar 2012    |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 7-10 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                               | 19. März 2012      |
| db x-trackers II IBOXX GBP LIQUID CORPORATE UCITS ETF <sup>*(1)(4)(7)</sup>                    | 15. Juni 2012      |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID COVERED UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                         | 27. November 2012  |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF INDONESIA GOVERNMENT UCITS ETF <sup>*(2)(3)(4)</sup>         | 5. Juni 2013       |
| db x-trackers II CANADIAN DOLLAR CASH UCITS ETF <sup>*(1)(2)(4)</sup>                          | 2. August 2013     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>         | 14. August 2013    |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN UCITS ETF <sup>*(4)</sup>   | 14. August 2013    |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN 1-3 UCITS ETF <sup>*(4)</sup>                                     | 14. August 2013    |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 1-3 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup> | 14. August 2013    |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 3-5 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup> | 14. August 2013    |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN SHORT DAILY UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>         | 15. November 2013  |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                     | 15. November 2013  |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF <sup>*(1)(2)(4)(5)</sup>             | 6. März 2014       |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                        | 8. Januar 2015     |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND SHORT DAILY UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>            | 8. Januar 2015     |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF <sup>*(2)(4)</sup>                    | 8. Januar 2015     |
| db x-trackers II HARVEST CSI CHINA SOVEREIGN BOND UCITS ETF (DR) <sup>(1)(2)(4)</sup>          | 8. Juli 2015       |

(1) An der London Stock Exchange notierter Teilfonds.

(2) An der Borsa Italiana notierter Teilfonds.

(3) An der Singapore Exchange notierter Teilfonds.

(4) An der Deutschen Börse Frankfurt notierter Teilfonds.

(5) An der SIX Swiss Exchange notierter Teilfonds.

(6) An der Hong Kong Stock Exchange notierter Teilfonds.

(7) An der Luxembourg Stock Exchange notierter Teilfonds (keine Market-Maker-Verpflichtung).

(8) An der Euronext Paris notierter Teilfonds.

(9) An der Börse Stuttgart notierter Teilfonds

Die Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds sind für jeden Teilfonds getrennt zu führen, wobei Drittgläubiger ausschließlich auf die Vermögenswerte des betreffenden Teilfonds Regress nehmen können.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



**1. Allgemeines (Fortsetzung)**

- a) Die Gesellschaft (Fortsetzung)

**Wichtige Ereignisse während des Berichtszeitraums:**

1. Während des zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums wechselte bei folgenden Teilfonds der Anlageverwalter von State Street Global Advisors Limited zu Deutsche Asset Management Investment GmbH, die bestimmte ihrer Portfoliomanagementaufgaben an die Deutsche Asset Management (UK) Limited delegieren wird:

| Teilfonds  | Stichtag      |
|--|---------------|
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF*            | 21. März 2016 |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF*        | 21. März 2016 |
| db x-trackers II US TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF* | 21. März 2016 |

2. Während des zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums wechselten folgende Teilfonds von einer Indirekten Anlagepolitik zu einer Direkten Anlagepolitik:

| Teilfonds  | Stichtag      |
|--|---------------|
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF*            | 21. März 2016 |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF*        | 21. März 2016 |
| db x-trackers II US TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF* | 21. März 2016 |

3. Während des zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums änderten die folgenden Teilfonds ihren Namen:

| Alter Name   | Neuer Name   | Stichtag      |
|--|--|---------------|
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF*            | db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR)                  | 21. März 2016 |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF*        | db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF (DR)              | 21. März 2016 |
| db x-trackers II US TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF* | db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR) | 21. März 2016 |

4. Während des zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums wechselten folgende Teilfonds ihre Ausschüttungspolitik von Thesaurierenden Anteilen zu Ausschüttenden Anteilen und wurden entsprechend umbenannt:

| Alter Name  | Neuer Name  | Stichtag      |
|---|---|---------------|
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF* – 1C        | db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF (DR) – 1D              | 21. März 2016 |
| db x-trackers II US TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF* – 1C | db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR) – 1D | 21. März 2016 |

5. Während des zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums änderte der folgende Teilfonds seinen Referenzindex:

| Teilfonds   | Stichtag      |
|---|---------------|
| db x-trackers II US TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF* (alter Referenzindex: USD IG INFLATION LINKED SOVEREIGN® Index, neuer Referenzindex: Markit iBoxx TIPS Inflation-Linked Index) | 21. März 2016 |

Weitere wichtige Ereignisse während des Berichtszeitraums sind unter Punkt 4 auf Seite 205 aufgeführt.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## 1. Allgemeines (Fortsetzung)

### b) Anlageziele und Anlagepolitik

Ein Teilfonds kann sein Anlageziel mittels einer Indirekten Anlagepolitik und/oder einer Direkten Anlagepolitik verfolgen, wie in den folgenden Absätzen ausführlicher beschrieben.

#### *Teilfonds mit Indirekter Anlagepolitik*

Teilfonds mit Indirekter Anlagepolitik („Fonds mit Indirekter Replikation“) können keine direkten Anlagen in die Bestandteile des Referenzindex tätigen. Die Abbildung der Wertentwicklung des Referenzindex erfolgt stattdessen durch Derivatetransaktionen und/oder derivative Instrumente (die „Derivatetransaktion(en)“). Insbesondere schließt ein Fonds mit Indirekter Replikation mit einem oder mehreren Swap-Kontrahenten zu marktüblichen Bedingungen ausgehandelte OTC-Swap-Transaktionen (die „OTC-Swap-Transaktion(en)“) ab.

Zur Erreichung seines Anlageziels kann ein Fonds mit Indirekter Replikation gemäß den Anlagebeschränkungen jederzeit die Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen ganz oder teilweise in Investierte Anlagen anlegen und eine oder mehrere Derivatetransaktionen mit dem Ziel durchführen, die Wertentwicklung und/oder den Ertrag dieser Investierten Anlagen ganz oder teilweise zum Aufbau eines Exposure in Bezug auf den Referenzindex auszutauschen (ein „Unfunded Swap“) (siehe Erläuterung 4).

Die Investierten Anlagen, die Derivatetransaktionen und die Techniken, die eingesetzt werden, um die Investierten Anlagen an den Referenzindex oder die Derivatetransaktionen zu koppeln, werden von dem jeweiligen Anlageverwalter und/oder Portfoliounterverwalter verwaltet. Die Verwaltung der Investierten Anlagen beinhaltet grundsätzlich nicht den aktiven Kauf und Verkauf von Wertpapieren auf Basis von Anlagebeurteilungen und Wirtschafts-, Finanz- und Marktanalysen.

Grundsätzlich hängt der Ertrag eines Anteilinhabers weitgehend von der Wertentwicklung der Investierten Anlagen, der Wertentwicklung des Referenzindex und der Entwicklung von Techniken zur Kopplung der Investierten Anlagen an den Referenzindex ab.

Ein Fonds mit Indirekter Replikation kann in Abhängigkeit vom Wert der Derivatetransaktionen jederzeit ein vollständiges oder teilweises Exposure in Bezug auf einen oder mehrere Kontrahenten (einschließlich eines oder mehrerer Swap-Kontrahenten) aufweisen. In diesem Fall werden Vorkehrungen zur Minderung von Kontrahentenrisiken in Einklang mit den Vorschriften implementiert und/oder die Kontrahenten der Derivatetransaktionen leisten Zahlungen, um sicherzustellen, dass der Prozentsatz des Kontrahentenrisikos die in den Vorschriften angegebenen Grenzwerte nicht übersteigt.

#### *Teilfonds mit Direkter Anlagepolitik*

Teilfonds mit direkter Anlagepolitik enthalten das Kürzel „(DR)“ im Namen der Teilfonds.

Teilfonds mit direkter Anlagepolitik („Fonds mit Direkter Replikation“) verfolgen ihr Anlageziel durch Anlage in ein Portfolio aus übertragbaren Wertpapieren oder sonstigen geeigneten Vermögenswerten, das aus allen (oder in Ausnahmefällen einer wesentlichen Anzahl von) Bestandteilen des Referenzindex („Vollständige Indexnachbildung“), einer optimierten Auswahl dieser Bestandteile oder nicht mit dem Referenzindex in Zusammenhang stehenden übertragbaren Wertpapieren oder sonstigen geeigneten Vermögenswerten („Optimierte Indexnachbildung“) bestehen kann.

Fonds mit Direkter Replikation halten unter Umständen nicht jeden Bestandteil bzw. nicht die genaue Gewichtung eines Bestandteils im Referenzindex. Stattdessen können sie durch den Einsatz von Optimierungstechniken und/oder Anlagen in Wertpapiere, die nicht Bestandteil eines Referenzindex sind, ein Exposure in Bezug auf diesen Referenzindex anstreben. Die Wertpapierkategorien, in die Fonds mit Direkter Replikation anlegen dürfen, sind u.a. American Depositary Receipts („ADR“), Global Depositary Receipts („GDR“) und/oder stimmrechtslose (Non Voting) Depositary Receipts („NVDR“).

Der Umfang, in dem Fonds mit Direkter Replikation Optimierungstechniken einsetzen, hängt zum Teil von der Art der Bestandteile des Referenzindex ab. Beispielsweise kann ein Fonds mit Direkter Replikation Optimierungstechniken einsetzen und eine mit der des Referenzindex vergleichbare Rendite erzielen, indem er in eine Teilmenge der Bestandteile seines Referenzindex anlegt. Es ist jedoch möglich, dass der Einsatz dieser Anlagetechniken, deren Umsetzung einer Reihe von Beschränkungen unterliegt, die im Abschnitt „Anlagebeschränkungen“ des Prospekts dargelegt sind, nicht die gewünschten Ergebnisse erzielt

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## 1. Allgemeines (Fortsetzung)

### c) Die Anteile

Die Anteile können in ausschüttende Anteile (gekennzeichnet durch den Buchstaben „D“) und thesaurierende Anteile (gekennzeichnet durch den Buchstaben „C“) unterteilt werden. Es können auch andere Klassen mit besonderen Merkmalen angeboten werden, wie etwa einer Umtausch- oder Rücknahmegebühr, einem Mindestzeichnungsbetrag oder anderen besonderen Merkmalen. Innerhalb jeder Anteilsklasse können verschiedene Arten von (durch Großbuchstaben gekennzeichneten) Unterklassen ausgegeben werden, die sich (unter anderem) hinsichtlich der Art der Ausschüttungen, der Ausschüttungstermine und der Gebührenstrukturen unterscheiden können. Sofern im jeweiligen Produktanhang des Prospekts nicht anders angegeben werden die Anteile zum Handel an einer oder mehreren Börsen zugelassen.

Die Anteile werden von der Gesellschaft ausschließlich in Bezug auf Teilfonds mit den im Prospekt beschriebenen Anlagepolitiken ausgegeben, und können gegen Barzahlung oder Sachleistung (oder einer Kombination aus beiden) gezeichnet werden.

## 2. Rechnungslegungsgrundsätze

Der Halbjahresabschluss der Gesellschaft wurde gemäß den in Luxemburg allgemein anerkannten und für Investmentfonds anwendbaren Rechnungslegungsgrundsätzen erstellt. Es wurden die folgenden wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze angewandt:

### a) Bewertung der Vermögenswerte

Der Nettoinventarwert (NAV) der Gesellschaft entspricht zu jeder Zeit der Summe der Nettoinventarwerte der Teilfonds in der Basiswährung der Gesellschaft.

Der Nettoinventarwert der Teilfonds ist nach Maßgabe der folgenden Vorschriften zu ermitteln:

- (i) der Wert von Barbeständen oder Einlagen, Rechnungen und Zahlungsaufforderungen und Forderungen, Rechnungsabgrenzungsposten sowie erklärten oder aufgelaufenen aber noch nicht vereinnahmten Bardividenden und Zinsen gilt als der Gesamtbetrag hiervon, es sei denn, die vollständige Zahlung oder der vollständige Erhalt sind in irgendeinem Fall unwahrscheinlich – in diesem Fall wird der Wert hiervon nach einem solchen Abschlag festgesetzt, wie dies in einem solchen Fall als angebracht erscheint, um den wahren Wert hiervon widerzuspiegeln;
- (ii) der Wert aller Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder gehandelt werden oder an einem anderen Geregelten Markt gehandelt werden, wird auf der Grundlage der zuletzt verfügbaren Kurse, die am dem Bewertungstag unmittelbar vorausgehenden Geschäftstag ermittelt werden, oder auf der Grundlage der letzten verfügbaren Kurse des Hauptmarktes bewertet, an dem die Anlagen der Teilfonds hauptsächlich gehandelt werden. Der Verwaltungsrat wird einen Dienstleister bestimmen, der die vorstehend genannten Kurse zur Verfügung stellen wird. Sollten nach Auffassung des Verwaltungsrats diese Kurse den Marktwert der betreffenden Wertpapiere nicht angemessen widerspiegeln, ermittelt der Verwaltungsrat den Wert dieser Wertpapiere nach Treu und Glauben entweder durch Bezugnahme auf andere öffentlich verfügbare Quellen oder durch Bezugnahme auf nach seinem Ermessen geeignete sonstige Quellen;
- (iii) nicht an einer Börse oder an einem Geregelten Markt notierte oder gehandelte Wertpapiere werden auf der Grundlage des wahrscheinlichen Verkaufspreises bewertet, wie mit der gebotenen Sorgfalt und nach Treu und Glauben durch den Verwaltungsrat festgelegt;
- (iv) die Swap-Kontrakte werden auf der Grundlage von Total-Return-Swaps bewertet, die dem positiven oder negativen Nettowert entsprechen, der sich einerseits aus dem Anstieg/der Verringerung des Marktpreises des Anlageportfolios, einschließlich der mit diesen Anlagen erzielten Zinserträge, und andererseits aus dem Marktwert des dem Swap-Kontrakt zugrunde liegenden Index ergibt. Der positive oder negative Nettowert wird im Halbjahresabschluss als „Nicht realisierter Gewinn aus Swaps“ oder als „Nicht realisierter Verlust aus Swaps“ ausgewiesen.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## 2. Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

### a) Bewertung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

- (v) für Teilfonds, die ihre Nettoerlöse vollständig oder teilweise in Swap-Transaktionen anlegen, stellen „Forderungen gegenüber Swap-Kontrahenten“ an den Kontrahenten des Swap-Kontrakts zur Finanzierung des Swaps (zum Nennwert) geleistete Vorauszahlungen dar. Swap-Kontrakte werden wie vorstehend unter (iv) beschrieben bewertet;
- (vi) alle anderen Wertpapiere und anderen zulässigen Vermögenswerte sowie alle vorstehend erwähnten Vermögenswerte, für die eine Bewertung in Übereinstimmung mit den vorstehenden Unterabsätzen nicht möglich oder zweckmäßig ist oder den Wert nicht angemessen widerspiegelt, werden zum nach Treu und Glauben nach Maßgabe vom Verwaltungsrat eingeführter Verfahren ermittelten Marktwert bewertet.

### b) Anlagegeschäfte

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Anlagen wird auf der Grundlage der durchschnittlichen Kosten für veräußerte Anlagen bestimmt. Die Verbuchung von Anlagegeschäften erfolgt am jeweiligen Handelsdatum.

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Anlagen wird im Jahresabschluss als „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagegeschäften“ ausgewiesen.

Die Kosten der inflationsgebundenen Anleihen werden inflationsbereinigt, und diese Bereinigungen werden als Zinsen auf Anleihen ausgewiesen.

### c) Umrechnung von Fremdwährungen

Die Geschäftsbücher der einzelnen Teilfonds werden in der jeweiligen Referenzwährung geführt. Die kombinierte Nettovermögensaufstellung sowie die Erfolgsrechnung und Veränderung des Nettovermögens der Gesellschaft werden auf der Grundlage des zum Zeitpunkt der Nettovermögensaufstellung maßgeblichen Wechselkurses in Euro ausgewiesen.

Erträge und Aufwendungen in anderen Währungen als der Referenzwährung eines Teilfonds werden zu dem am Tag der Transaktion geltenden Wechselkurs in die Referenzwährung des jeweiligen Teilfonds umgerechnet.

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in einer anderen Währung als der Referenzwährung eines Teilfonds werden zu dem Wechselkurs, der zum Zeitpunkt der Nettovermögensaufstellung gilt, in die Referenzwährung des jeweiligen Teilfonds umgerechnet.

Die am 30. Juni 2016 maßgeblichen Wechselkurse sind:

1 Euro = 1,492008 AUD  
1 Euro = 1,442790 CAD  
1 Euro = 0,831051 GBP  
1 Euro = 113,972300 JPY  
1 Euro = 1,495227 SGD  
1 Euro = 1,110949 USD

### d) Erträge

Zinsen werden periodengerecht verbucht. Die Verbuchung von Dividenden erfolgt am „Ex-Tag“ nach Abzug von Quellensteuern.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

### 3. Besteuerung der Gesellschaft

Nach geltendem Recht und gängiger Praxis ist die Gesellschaft in Luxemburg nicht zur Zahlung von Ertragsteuern, Stempel- oder sonstigen Steuern verpflichtet. Auf etwaige von der Gesellschaft vereinnahmte oder realisierte Anlageerträge und Veräußerungsgewinne können jedoch im Ursprungsland Steuern zu unterschiedlichen Sätzen erhoben werden, die der Gesellschaft in der Regel nicht erstattet werden.

Obwohl die Gesellschaft grundsätzlich in Luxemburg einer Zeichnungssteuer („Taxe d'Abonnement“) zu einem jährlichen Satz von 0,05% unterliegt, sind alle Teilfonds von dieser Steuer befreit, da (i) alle ihre Anteile an mindestens einer Börse oder einem sonstigen anerkannten, öffentlich zugänglichen, geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, und (ii) die Teilfonds das alleinige Ziel verfolgen, die Wertentwicklung eines oder mehrerer Indizes abzubilden, wobei der Umstand einer Beschränkung auf ein alleiniges Ziel daneben nicht die Verwaltung eventueller liquider Mittel oder den Einsatz von Techniken und Instrumenten zu Absicherungszwecken oder für den Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung ausschließt. Durch eine Großherzogliche Verordnung können zusätzliche oder alternative Kriterien bezüglich der unter diese Ausnahme fallenden Indizes festgelegt werden.

Für einzelne Teilvermögen von im Gesetz von 2010 aufgeführten OGA, die aus mehreren Teilvermögen bestehen, sowie für einzelne Wertpapierklassen, die von einem OGA oder innerhalb eines Teilvermögens eines aus mehreren Teilvermögen bestehenden OGA emittiert werden, gilt eine reduzierte Zeichnungssteuer von 0,01 % p. a., sofern die Wertpapiere dieser Teilvermögen oder Klassen ausschließlich einem oder mehreren institutionellen Anlegern vorbehalten sind.

### 4. Swaps

Die Swap-Kontrakte werden so abgeschlossen, dass zu Beginn der Laufzeit der Teilfonds die Kosten der übertragbaren Wertpapiere und Geldmarktinstrumente in etwa dem theoretischen Wert des Basiswerts entsprechen. Diese Position kann sich jedoch während der Laufzeit des Swaps ändern, wodurch die Kosten der übertragbaren Wertpapiere und Geldmarktinstrumente einschließlich der erworbenen aufgelaufenen Nettozinsen unter Umständen höher/niedriger werden als der theoretische

Wert des Basiswerts infolge zusätzlicher Käufe/Verkäufe von übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten im Vergleich zum theoretischen Wert des Basiswerts. Die Differenz zwischen diesen theoretischen Werten wird im Halbjahresabschluss als „Forderungen gegenüber Swap-Kontrahenten“ bzw. als „Verbindlichkeiten gegenüber Swap-Kontrahenten“ ausgewiesen und offengelegt, je nachdem, welcher theoretische Wert höher ist. Bei Beendigung des jeweiligen Swap-Kontrakts werden die Forderungsbestände von dem Swap-Kontrahenten an den Teilfonds und die Verbindlichkeitsbestände von dem Teilfonds an den Swap-Kontrahenten gezahlt.

Die nachstehende Tabelle enthält eine Aufstellung der aus den Swaps zu zahlenden und zu erhaltenden theoretischen Werte sowie den nicht realisierten Gewinn/(Verlust) aus Swaps für jeden Teilfonds.

| Teilfonds  | Zugrunde liegender Basiswert            | Währung | Zu zahlender theoretischer Wert | Zu erhaltender theoretischer Wert | Forderung/ (Verbindlichkeit) gegenüber Swap-Kontrahenten | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Swaps |
|--|---|---------|---------------------------------|-----------------------------------|--|---|
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF*      | IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE® INDEX      | EUR     | 1.610.151.089                   | 1.527.456.438                     | (82.694.651)   | 82.662.250                                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF*  | IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE 1-3® INDEX  | EUR     | 369.684.630                     | 359.966.056                       | (9.718.574)  | 9.198.058                                     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF*  | IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE 3-5® INDEX  | EUR     | 471.464.763                     | 451.728.623                       | (19.736.140)   | 24.807.194                                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF*  | IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE 5-7® INDEX  | EUR     | 273.150.817                     | 257.490.130                       | (15.660.687)   | 15.015.544                                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF* | IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE 7-10® INDEX | EUR     | 145.978.619                     | 143.609.662                       | (2.368.957)  | 5.884.746                                     |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## 4. Swaps (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Zugrunde liegender Basiswert   | Wahrung | Zu zahlender theoretischer Wert | Zu erhaltender theoretischer Wert | Forderung/ (Verbindlichkeit) gegenuber Swap-Kontrahenten | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Swaps |
|---|--|----------|---------------------------------|-----------------------------------|---|---|
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF*           | IBOXX  SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 <sup></sup> INDEX                 | EUR      | 27.196.974                      | 24.056.730                        | (3.140.244)   | 1.096.082                                     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF*             | IBOXX  SOVEREIGNS EUROZONE 15+ <sup></sup> INDEX                   | EUR      | 39.959.952                      | 39.992.707                        | 32.755  | (587.465)                                     |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+ UCITS ETF*             | IBOXX  SOVEREIGNS EUROZONE 25+ <sup></sup> INDEX                   | EUR      | 50.031.066                      | 50.024.979                        | (6.087)   | 862.381                                       |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*             | IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED TOTAL RETURN INDEX HEDGED <sup></sup> | EUR      | 471.147.210                     | 577.332.094                       | 106.184.884   | (94.378.978)                                  |
| db x-trackers II IBOXX EURO INFLATION-LINKED UCITS ETF*               | IBOXX EURO INFLATION-LINKED TOTAL RETURN INDEX <sup></sup>          | EUR      | 371.811.157                     | 363.372.320                       | (8.438.837)   | 11.028.737                                    |
| db x-trackers II EONIA UCITS ETF*                                     | DEUTSCHE BANK EONIA TOTAL RETURN INDEX <sup></sup>                  | EUR      | 581.045.265                     | 616.176.811                       | 35.131.546  | (27.818.385)                                  |
| db x-trackers II ITRAXX <sup></sup> EUROPE UCITS ETF*                | MARKIT ITRAXX <sup></sup> EUROPE 5-YEAR TOTAL RETURN INDEX          | EUR      | 32.147.526                      | 32.756.439                        | 608.913   | (375.226)                                     |
| db x-trackers II ITRAXX <sup></sup> CROSSOVER UCITS ETF*             | MARKIT ITRAXX <sup></sup> CROSSOVER 5-YEAR TOTAL RETURN INDEX       | EUR      | 315.978.847                     | 343.296.424                       | 27.317.577  | (18.754.439)                                  |
| db x-trackers II ITRAXX <sup></sup> EUROPE SHORT DAILY UCITS ETF*    | MARKIT ITRAXX <sup></sup> EUROPE 5-YEAR SHORT TOTAL RETURN INDEX    | EUR      | 5.748.101                       | 3.611.048                         | (2.137.053)   | (740.218)                                     |
| db x-trackers II ITRAXX <sup></sup> CROSSOVER SHORT DAILY UCITS ETF* | MARKIT ITRAXX <sup></sup> CROSSOVER 5-YEAR SHORT TOTAL RETURN INDEX | EUR      | 44.093.752                      | 46.704.381                        | 2.610.629   | (2.451.904)                                   |
| db x-trackers II EMERGING MARKETS LIQUID EUROBOND UCITS ETF*          | DEUTSCHE BANK EMERGING MARKETS LIQUID EUROBOND INDEX <sup></sup>    | EUR      | 420.682.935                     | 391.372.579                       | (29.310.356)  | 30.739.942                                    |
| db x-trackers II SHORT IBOXX  SOVEREIGNS EUROZONE DAILY UCITS ETF*   | SHORT IBOXX <sup></sup>  SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX    | EUR      | 159.028.297                     | 207.038.602                       | 48.010.305  | (52.665.188)                                  |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF*                     | IBOXX  GERMANY COVERED <sup></sup> INDEX                           | EUR      | 158.760.935                     | 144.652.657                       | (14.108.278)  | 15.411.152                                    |
| db x-trackers II IBOXX  GILTS UCITS ETF*                             | IBOXX  GILTS <sup></sup> INDEX                                     | GBP      | 5.014.754                       | 4.359.680                         | (655.074)   | (355.852)                                     |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## 4. Swaps (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Zugrunde liegender Basiswert  | Wahrung | Zu zahlender theoretischer Wert | Zu erhaltender theoretischer Wert | Forderung/ (Verbindlichkeit) gegenuber Swap-Kontrahenten | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Swaps |
|---|---|----------|---------------------------------|-----------------------------------|---|---|
| db x-trackers II IBOXX UK GILT INFLATION-LINKED UCITS ETF*        | IBOXX UK GILT INFLATION-LINKED TOTAL RETURN INDEX®                              | GBP      | 12.628.299                      | 5.544.132                         | (7.084.167)   | (1.080.601)                                   |
| db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE RATE UCITS ETF*              | FED FUNDS EFFECTIVE RATE TOTAL RETURN INDEX®                                    | USD      | 625.546.381                     | 653.427.674                       | 27.881.293  | (27.546.054)                                  |
| db x-trackers II STERLING CASH UCITS ETF*                         | SONIA TOTAL RETURN INDEX®   | GBP      | 67.407.604                      | 59.233.032                        | (8.174.572)   | (12.693.165)                                  |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF*                      | DEUTSCHE BANK GLOBAL INVESTMENT GRADE GOVERNMENT INDEX                          | EUR      | 760.508.786                     | 714.035.330                       | (46.473.456)  | 3.505.436                                     |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF INDONESIA GOVERNMENT UCITS ETF* | MARKIT IBOXX ABF INDONESIA GOVERNMENT® TOTAL RETURN (NET WITHHOLDING TAX) INDEX | USD      | 5.230.725                       | 5.119.042                         | (111.683)   | 284.218                                       |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF SINGAPORE GOVERNMENT UCITS ETF* | MARKIT IBOXX ABF SINGAPORE GOVERNMENT® TOTAL RETURN INDEX                       | SGD      | 41.997.155                      | 38.395.787                        | (3.601.368)   | 4.107.772                                     |
| db x-trackers II SINGAPORE DOLLAR CASH UCITS ETF*                 | DEUTSCHE BANK SORA TOTAL RETURN INDEX®  | SGD      | 1.342.089                       | 1.130.837                         | (211.252)   | 236.593                                       |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS 1-5 UCITS ETF*                     | IBOXX £ GILTS 1-5® INDEX  | GBP      | 5.689.342                       | 5.685.201                         | (4.141)   | 134.748                                       |
| db x-trackers II UK GILTS SHORT DAILY UCITS ETF*                  | DEUTSCHE BANK SHORT DAILY GBP GILTS TOTAL RETURN INDEX™                         | GBP      | 11.151.576                      | 13.298.611                        | 2.147.035   | (3.669.516)                                   |
| db x-trackers II US TREASURIES SHORT DAILY UCITS ETF*             | DEUTSCHE BANK US TREASURIES SHORT DAILY INDEX™                                  | USD      | 4.919.516                       | 5.271.165                         | 351.649   | (782.879)                                     |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF*            | IBOXX EUR LIQUID CORPORATE 100 INDEX®   | EUR      | 264.865.549                     | 256.981.042                       | (7.884.507)   | 8.114.034                                     |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF*                         | IBOXX € GERMANY® INDEX  | EUR      | 88.899.321                      | 83.197.988                        | (5.701.333)   | 1.149.840                                     |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 1-3 UCITS ETF*                     | IBOXX € GERMANY 1-3® INDEX  | EUR      | 55.300.826                      | 54.619.824                        | (681.002)   | 144.829                                       |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF KOREA GOVERNMENT UCITS ETF†     | MARKIT IBOXX ABF KOREA GOVERNMENT® TOTAL RETURN NET-OF-TAX (USD UNHEDGED) INDEX | USD      | 18.932.341                      | 16.159.854                        | (2.772.487)   | 2.319.842                                     |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## 4. Swaps (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Zugrunde liegender Basiswert                                       | Wahrung | Zu zahlender theoretischer Wert | Zu erhaltender theoretischer Wert | Forderung/ (Verbindlichkeit) gegenuber Swap-Kontrahenten | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) aus Swaps |
|---|--|----------|---------------------------------|-----------------------------------|---|--|
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF*     | IBOXX EUR LIQUID CORPORATE 100 FINANCIALS SUB-INDEX®               | EUR      | 16.301.978                      | 14.617.530                        | (1.684.448)   | 1.520.757                                      |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF* | IBOXX EUR LIQUID CORPORATE 100 NON-FINANCIALS SUB-INDEX®           | EUR      | 56.461.228                      | 55.425.080                        | (1.036.148)   | 1.255.560                                      |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA UCITS ETF*             | IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE AAA® INDEX                             | EUR      | 194.154.722                     | 189.999.877                       | (4.154.845)   | 3.784.716                                      |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF*      | MARKIT IBOXX EUR SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS INDEX®             | EUR      | 1.743.452.046                   | 1.630.372.731                     | (113.079.315)   | 97.411.304                                     |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF*                    | DEUTSCHE BANK AUSTRALIA OVERNIGHT MONEY MARKET TOTAL RETURN INDEX® | AUD      | 36.353.935                      | 31.498.191                        | (4.855.744)   | (166.118)                                      |
| db x-trackers II AUSTRALIA SSA BONDS UCITS ETF*                       | DB AUSTRALIA SSA BONDS TOTAL RETURN INDEX                          | AUD      | 44.482.064                      | 37.717.651                        | (6.764.413)   | 3.135.902                                      |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED 1-3 UCITS ETF*                 | IBOXX € GERMANY COVERED 1-3® INDEX                                 | EUR      | 7.713.689                       | 7.402.891                         | (310.798)   | (85.101)                                       |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER 2X SHORT DAILY UCITS ETF*          | MARKIT ITRAXX® CROSSOVER 5-YEAR 2X SHORT DAILY TOTAL RETURN INDEX  | EUR      | 21.070.036                      | 20.223.559                        | (846.477)   | (208.655)                                      |
| db x-trackers II IBOXX GBP LIQUID CORPORATE UCITS ETF*                | IBOXX GBP LIQUID CORPORATE 100 INDEX®                              | GBP      | 4.828.116                       | 2.907.283                         | (1.920.833)   | (272.426)                                      |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BOT UCITS ETF*                  | MTS ITALY BOT – EX-BANK OF ITALY® INDEX                            | EUR      | 186.238.155                     | 177.589.047                       | (8.649.108)   | 6.229.937                                      |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY AGGREGATE UCITS ETF*            | MTS ITALY AGGREGATE – EX-BANK OF ITALY® INDEX                      | EUR      | 71.367.599                      | 70.336.986                        | (1.030.613)   | 231.460  |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BTP UCITS ETF*                  | MTS ITALY BTP – EX-BANK OF ITALY® INDEX                            | EUR      | 17.723.742                      | 17.471.515                        | (252.227)   | (241.820)                                      |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 3-5 UCITS ETF*                         | IBOXX € GERMANY 3-5® INDEX   | EUR      | 2.871.313                       | 2.589.495                         | (281.818)   | 1.752  |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA 1-3 UCITS ETF*         | IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE AAA 1-3® INDEX                         | EUR      | 3.024.141                       | 2.934.658                         | (89.483)  | 110.278  |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



## 4. Swaps (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Zugrunde liegender Basiswert   | Währung | Zu zahlender theoretischer Wert | Zu erhaltender theoretischer Wert | Forderung/ (Verbindlichkeit) gegenüber Swap-Kontrahenten | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) aus Swaps |
|--|--|---------|---------------------------------|-----------------------------------|--|--|
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 7-10 UCITS ETF*                               | IBOXX € GERMANY 7-10 <sup>®</sup> INDEX                                | EUR     | 2.920.845                       | 2.984.673                         | 63.828   | 23.214   |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID COVERED UCITS ETF*                         | MARKIT IBOXX EUR LIQUID COVERED INDEX <sup>®</sup>                     | EUR     | 53.415.713                      | 53.368.817                        | (46.896)   | 1.185.273                                      |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 1-3 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | MTS ITALY AGGREGATE 1 - 3 YEARS – EX-BANK OF ITALY INDEX <sup>®</sup>  | EUR     | 4.903.315                       | 4.697.466                         | (205.849)  | 125.908  |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 3-5 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | MTS ITALY AGGREGATE 3 - 5 YEARS – EX-BANK OF ITALY INDEX <sup>®</sup>  | EUR     | 6.020.895                       | 3.868.978                         | (2.151.917)  | 110.023  |
| db x-trackers II CANADIAN DOLLAR CASH UCITS ETF*                             | DB CANADIAN DOLLAR ON (OVERNIGHT) INDEX <sup>®</sup>                   | CAD     | 28.849.052                      | 27.224.963                        | (1.624.089)  | 845.344  |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF*         | MARKIT IBOXX EUR SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 INDEX <sup>®</sup> | EUR     | 887.786.522                     | 824.693.497                       | (63.093.025)   | 25.277.344                                     |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN UCITS ETF*                                      | IBOXX € SPAIN <sup>®</sup> INDEX                                       | EUR     | 1.130.977                       | 883.092                           | (247.885)  | (41.477)                                       |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN 1-3 UCITS ETF*                                  | IBOXX € SPAIN 1-3 <sup>®</sup> INDEX                                   | EUR     | 6.240.381                       | 5.836.562                         | (403.819)  | 126.191  |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN UCITS ETF*                     | MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN INDEX                                     | JPY     | 6.224.458.420                   | 6.097.914.912                     | (126.543.508)  | 190.702.895                                    |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN SHORT DAILY UCITS ETF*         | MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN SHORT DAILY INDEX                         | JPY     | 769.863.381                     | 846.683.844                       | 76.820.463   | (77.997.733)                                   |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*                   | BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND INDEX                                   | USD     | 941.952.760                     | 956.860.180                       | 14.907.420   | (7.485.771)                                    |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF*                        | MARKIT IBOXX EUR LIQUID HIGH YIELD INDEX                               | EUR     | 191.790.872                     | 191.849.919                       | 59.047   | (757.994)                                      |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND SHORT DAILY UCITS ETF*            | MARKIT SHORT IBOXX EUR LIQUID HIGH YIELD TOTAL RETURN INDEX            | EUR     | 3.447.922                       | 3.460.722                         | 12.800   | (173.253)                                      |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF*                    | MARKIT IBOXX EUR LIQUID HIGH YIELD 1-3 INDEX                           | EUR     | 66.245.612                      | 69.435.715                        | 3.190.103  | (2.202.499)                                    |

Während des zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums war die Deutsche Bank AG, handelnd durch ihre Niederlassung London, Kontrahent bei allen von der Gesellschaft eingegangenen Swap-Positionen.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## 5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr und Fixgebühr

### a) Verwaltungsgesellschaftsgebühr

In Übereinstimmung mit und vorbehaltlich der Bedingungen der Verwaltungsgesellschaftsvereinbarung läuft die jährliche Verwaltungsgesellschaftsgebühr an jedem Kalendertag auf und wird an jedem Bewertungstag auf der Grundlage eines Prozentsatzes (i) des zuletzt verfügbaren Nettoinventarwerts jedes Teilfonds bzw. jeder Anteilsklasse oder (ii) des Erstausgabepreises, multipliziert mit der Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile jedes Teilfonds oder jeder Anteilsklasse (wie im jeweiligen Produktanhang des Prospekts für jeden Teilfonds bzw. jede Anteilsklasse angegeben) berechnet. Die Verwaltungsgesellschaftsgebühr ist vierteljährlich zahlbar.

Die Verwaltungsgesellschaft hat darüber hinaus Anspruch auf Erstattung von Auslagen in angemessener Höhe, die im Rahmen ihrer Funktion als Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft im Zusammenhang mit der Ausführung der Verwaltungsgesellschaftsvereinbarung angefallen sind und im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit nach vernünftigem Ermessen nicht vorhersehbar waren.

Ungeachtet des Vorstehenden können die Verwaltungsgesellschaft und die Gesellschaft in Bezug auf einen bestimmten Teilfonds oder eine bestimmte Anteilsklasse eine andere Gebührenstruktur vereinbaren, wie im jeweiligen Produktanhang des Prospekts angegeben.

Die Verwaltungsgesellschaft kann den Vertriebsstellen eine Vertriebsgebühr aus der Verwaltungsgesellschaftsgebühr zahlen. Eine Vertriebsstelle kann gegebenenfalls einen Teil der Vertriebsgebühr an eine Untervertriebsstelle weitergeben.

### b) Fixgebühr

Gemäß den Bedingungen einer Vereinbarung zwischen der Gesellschaft und der Deutsche Bank AG, handelnd durch ihre Niederlassung London (die „Fixgebührenstelle“), wird die Fixgebührenstelle gegen Zahlung einer Fixgebühr, die – zu einem in der nachstehenden Tabelle angegebenen Satz – auf Basis des durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwerts je Teilfonds oder Anteilsklasse berechnet wird und in regelmäßigen Abständen zahlbar ist, die Zahlung von bestimmten Gebühren und Aufwendungen übernehmen, sofern im betreffenden Produktanhang des Prospekts nicht anderweitig angegeben.

Die von der Vereinbarung abgedeckten Gebühren und Aufwendungen sind Verwaltungsstellengebühren, Verwahrstellengebühren, Register-, Transferstellen- und Börsenzulassungsstellengebühren, in Luxemburg jährlich zahlbare Steuern (falls zutreffend) (die „Taxe d'Abonnement“), Gründungskosten und sonstige Verwaltungsgebühren.

Die Fixgebühr beinhaltet nicht die folgenden Gebühren, Aufwendungen und Kosten:

- die Anlageverwaltungsgebühr;
- die Verwaltungsgesellschaftsgebühr;
- Zahlungen an Marketingagenturen, die von der Gesellschaft oder der Verwaltungsgesellschaft mit der Erbringung bestimmter Marketing- und Vertriebsleistungen für die Gesellschaft oder die Verwaltungsgesellschaft beauftragt wurden;
- Steuern oder Abgaben, zu deren Zahlung die Gesellschaft verpflichtet sein kann, mit Ausnahme der (etwaigen) „Taxe d'Abonnement“ oder gegebenenfalls von der Gesellschaft zu zahlende Mehrwertsteuern oder ähnliche Steuern auf Umsätze oder Leistungen (MwSt.) (alle diese fallen unter Steuern oder Abgaben), sofern im betreffenden Produktanhang des Prospekts nicht anderweitig angegeben;
- Aufwendungen aus Werbe- oder Verkaufsförderungsmaßnahmen in Verbindung mit der Gesellschaft; oder
- sonstige Kosten und Ausgaben, die nicht im Rahmen des üblichen Geschäftsgangs der Gesellschaft angefallen sind, wie außerordentliche Aufwendungen (z. B. Rechtsberatungskosten für die Wahrung von Rechten im Fall einer Klage oder eines Rechtsverfahrens der oder gegen die Gesellschaft).

Insbesondere wird die Fixgebührenstelle die Rechnungen von Rechtsberatern, örtlichen Zahlstellen und Übersetzern bis zu einer Gesamtbergrenze von EUR 10 Mio. (EUR 10.000.000) pro Geschäftsjahr bezahlen; die Gesellschaft ist für die Zahlung von über diese Gesamtbergrenze hinausgehenden Beträgen verantwortlich. Die Gesellschaft wird diese Beträge aus dem Vermögen des betreffenden Teilfonds, dem die spezifischen Kosten zuzurechnen sind, begleichen.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

**5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr und Fixgebühr (Fortsetzung)**

## b) Fixgebühr (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Verwaltungs-<br>gesellschafts-<br>gebühr (p.a.) | Fix-<br>gebühr<br>(p.a.) |
|---|---|--------------------------|
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF*                 | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF*             | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF*             | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF*             | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF*            | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF*           | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF*             | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+ UCITS ETF*             | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*             | bis zu 0,15%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX EURO INFLATION-LINKED UCITS ETF*               | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II EONIA UCITS ETF*(1)                                  | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II ITRAXX® EUROPE UCITS ETF*                            | bis zu 0,08%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER UCITS ETF*                         | bis zu 0,14%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II ITRAXX® EUROPE SHORT DAILY UCITS ETF*                | bis zu 0,08%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER SHORT DAILY UCITS ETF*             | bis zu 0,14%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II EMERGING MARKETS LIQUID EUROBOND UCITS ETF*          | bis zu 0,45%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II SHORT IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE DAILY UCITS ETF*   | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF*                     | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS UCITS ETF*                             | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX UK GILT INFLATION-LINKED UCITS ETF*            | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE RATE UCITS ETF*                  | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II STERLING CASH UCITS ETF*                             | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF*                          | bis zu 0,15%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF INDONESIA GOVERNMENT UCITS ETF*     | bis zu 0,30%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF SINGAPORE GOVERNMENT UCITS ETF*     | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II SINGAPORE DOLLAR CASH UCITS ETF*                     | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS 1-5 UCITS ETF*                         | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR)                   | bis zu 0,05%                                    | 0,15%                    |
| db x-trackers II UK GILTS SHORT DAILY UCITS ETF*                      | bis zu 0,15%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR)  | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II US TREASURIES SHORT DAILY UCITS ETF*                 | bis zu 0,15%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF (DR)               | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE UCITS ETF*                | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF*                             | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 1-3 UCITS ETF*                         | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF KOREA GOVERNMENT UCITS ETF*         | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF*     | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF* | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA UCITS ETF*             | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF*      | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF*                    | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II AUSTRALIA SSA BONDS UCITS ETF*                       | bis zu 0,15%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED 1-3 UCITS ETF*                 | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER 2X SHORT DAILY UCITS ETF*          | bis zu 0,24%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX GBP LIQUID CORPORATE UCITS ETF*                | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BOT UCITS ETF*                  | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY AGGREGATE UCITS ETF*            | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BTP UCITS ETF*                  | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 3-5 UCITS ETF*                         | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |

(1) Im Anschluss an das Schreiben vom 26. April 2016, hat die Fixgebührenstelle zugestimmt, während des Zeitraums vom 1. Juli 2015 bis einschließlich 30. April 2016 die Fixgebühr in Bezug auf die Anteilsklasse 2C des Teilfonds db x-trackers II EONIA UCITS ETF\* von 0.00833% pro Monat (0.10% p.a.) auf 0.00417% pro Monat (0.05% p. a.) zu senken. Die Fixgebühr wird ab 1. Mai 2016 auf 0.00833% pro Monat (0.10% p.a.) zurückgesetzt.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

**5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr und Fixgebühr (Fortsetzung)**

## b) Fixgebühr (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Verwaltungs-<br>gesellschafts-<br>gebühr (p.a.) | Fix-<br>gebühr<br>(p.a.) |
|--|---|--------------------------|
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA 1-3 UCITS ETF*                | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 7-10 UCITS ETF*                               | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID COVERED UCITS ETF*                         | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 1-3 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 3-5 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II CANADIAN DOLLAR CASH UCITS ETF*                             | bis zu 0,05%                                    | 0,15%                    |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF*         | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN UCITS ETF*                                      | bis zu 0,10%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN 1-3 UCITS ETF*                                  | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN UCITS ETF*                     | bis zu 0,05%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN SHORT DAILY UCITS ETF*         | bis zu 0,15%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*                   | bis zu 0,20%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF*                        | bis zu 0,25%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND SHORT DAILY UCITS ETF*            | bis zu 0,25%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF*                    | bis zu 0,25%                                    | 0,10%                    |
| db x-trackers II HARVEST CSI CHINA SOVEREIGN BOND UCITS ETF (DR)             | bis zu 0,40%                                    | 0,15%                    |

**6. Verbundene Parteien**

Deutsche Asset Management S.A. wurde gemäß der Verwaltungsgesellschaftsvereinbarung als Verwaltungsgesellschaft bestellt und ist dafür verantwortlich, für die verschiedenen Teilfonds Anlageverwaltungs-, Verwaltungs- sowie Vertriebs- und Marketingdienstleistungen zu erbringen, sofern im maßgeblichen Produktanhang des Prospekts nicht anderweitig festgelegt.

Deutsche Asset Management S.A. hat für die Erbringung ihrer Dienstleistungen gegenüber der Gesellschaft Anspruch auf Erhalt folgender Gebühren:

- Verwaltungsgesellschaftsgebühren wie in Erläuterung 5 näher beschrieben;
- Gebühren, die direkte oder indirekte Betriebskosten abdecken.

Die Fixgebührenstelle hat Anspruch auf Erhalt von Fixgebühren, wie in Erläuterung 5 näher beschrieben.

Während des zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums war die Deutsche Bank AG, handelnd durch ihre Niederlassung London, Kontrahent bei allen von der Gesellschaft eingegangenen Swap-Positionen.

Die Deutsche Bank AG als Wertpapierleihstelle, die durch ihre Hauptniederlassung Frankfurt und ihre Niederlassungen London und New York handelt, hat Anspruch auf eine Vergütung, die ihre direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren aus den Wertpapierleihgeschäften abdeckt.

Jeder Teilfonds kann im Rahmen seiner üblichen Geschäftstätigkeit mit der Deutsche Bank AG oder Tochtergesellschaften der Deutschen Bank AG Wertpapier- und andere Anlagegeschäfte eingehen.

**7. Besteller Anlageverwalter**

State Street Global Advisors Limited fungiert als Anlageverwalter für sämtliche Teilfonds mit Ausnahme des db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR), des db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR) und des db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3 UCITS ETF (DR) für den Deutsche Asset Management Investment GmbH als Anlageverwalter fungiert und db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF\*, für den Deutsche Asset Management S.A. als Anlageverwalter fungiert und db x-trackers II HARVEST CSI CHINA SOVEREIGN BOND UCITS ETF (DR), für den Harvest Global Investments Limited als Anlageverwalter fungiert.

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

**8. Ausgeschüttete Dividenden**

Während des zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums beschloss die Gesellschaft, an die Anteilsinhaber der Ausschüttenden Anteile der nachstehend aufgeführten Teilfonds wie folgt Ausschüttungen vorzunehmen:

| Teilfonds  | An-teils-klasse | Ex- Tag       | Währung der Anteils-klasse | Dividende je Anteil |
|--|-----------------|---------------|----------------------------|---------------------|
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF*                        | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 2,2485              |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF*                    | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 1,0439              |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF*                    | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 1,1848              |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*                    | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 8,2160              |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*                    | 3D              | 4. April 2016 | GBP                        | 0,9566              |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*                    | 4D              | 4. April 2016 | CHF                        | 4,3447              |
| db x-trackers II EONIA UCITS ETF*  | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 3,6803              |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF*                            | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 3,9968              |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS UCITS ETF*                                    | 1D              | 4. April 2016 | GBP                        | 1,9808              |
| db x-trackers II IBOXX UK GILT INFLATION-LINKED UCITS ETF*                   | 1D              | 4. April 2016 | GBP                        | 5,2658              |
| db x-trackers II STERLING CASH UCITS ETF*                                    | 1D              | 4. April 2016 | GBP                        | 2,1818              |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF*                                 | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 2,0026              |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS ETF*                                 | 2D              | 4. April 2016 | GBP                        | 0,2441              |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS 1-5 UCITS ETF*                                | 1D              | 4. April 2016 | GBP                        | 2,2987              |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS ETF (DR)                          | 1D              | 4. April 2016 | USD                        | 4,4979              |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF*                                    | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 1,0976              |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 1-3 UCITS ETF*                                | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 0,6820              |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA UCITS ETF*                    | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 1,3712              |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF*             | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 2,5490              |
| db x-trackers II IBOXX GBP LIQUID CORPORATE UCITS ETF*                       | 1D              | 4. April 2016 | GBP                        | 1,5944              |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY AGGREGATE UCITS ETF*                   | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 0,8697              |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BTP UCITS ETF*                         | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 1,1126              |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 3-5 UCITS ETF*                                | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 0,6562              |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 7-10 UCITS ETF*                               | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 0,8292              |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 1-3 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 0,6472              |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 3-5 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 0,5570              |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF*         | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 1,0818              |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*                   | 1D              | 4. April 2016 | USD                        | 0,9668              |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF*                        | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 0,2260              |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF*                    | 1D              | 4. April 2016 | EUR                        | 0,3130              |
| db x-trackers II HARVEST CSI CHINA SOVEREIGN BOND UCITS ETF (DR)             | 1D              | 4. April 2016 | USD                        | 0,0864              |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

**9. Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlageportfolios**

Eine Aufstellung dieser Veränderungen wird den Anteilshabern von der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle am Sitz der Gesellschaft zur Verfügung gestellt. Auf Anfrage wird sie jedem kostenfrei zugesendet.

**10. Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlageportfolios für den in Hongkong vertriebenen Teilfonds**

Die Angaben in dieser Erläuterung betreffen nur den in Hongkong vertriebenen Teilfonds:

db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF\*

| Beschreibung  | Währung<br>(lokal) | Anteile/<br>Nennwert zum<br>31. Dezember<br>2015 | Käufe     | Verkäufe  | Anteile/<br>Nennwert zum<br>30. Juni 2016 |
|---|--------------------|--|-----------|-----------|---|
| <b>Nennwert</b>   |                    |  |           |           |   |
| <b>Österreich</b>   |                    |  |           |           |   |
| Oesterreichische Kontrollbank AG<br>1,125% 12 - 24.05.18      | CHF                | 1.000.000  | 0         | 0         | 1.000.000                                 |
| <b>Frankreich</b>   |                    |  |           |           |   |
| Caisse Francaise de Financement<br>Local 2,625% 09 - 12.08.19 | CHF                | 1.215.000  | 0         | 0         | 1.215.000                                 |
| Caisse Francaise de Financement<br>Local 5,50% 01 - 16.07.26  | GBP                | 2.417.000  | 0         | 2.417.000 | 0   |
| <b>Deutschland</b>  |                    |  |           |           |   |
| Bundesrepublik Deutschland 0,50%<br>15 - 15.02.25             | EUR                | 0  | 2.886.000 | 0         | 2.886.000                                 |
| Bundesrepublik Deutschland 2,50%<br>14 - 15.08.46             | EUR                | 0  | 2.900.000 | 0         | 2.900.000                                 |
| Bundesrepublik Deutschland 3,50%<br>09 - 04.07.19             | EUR                | 1.300.000  | 0         | 1.300.000 | 0   |
| Deutsche Telekom AG Zero Coupon<br>- 90 - 31.12.19            | EUR                | 8.200.000  | 0         | 0         | 8.200.000                                 |
| Deutsche Hypothekenbank AG<br>2,50% 06 - 08.03.18             | CHF                | 1.500.000  | 0         | 0         | 1.500.000                                 |
| <b>Italien</b>  |                    |  |           |           |   |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>5,00% 12 - 27.01.21                    | EUR                | 2.000.000  | 0         | 0         | 2.000.000                                 |
| <b>Niederlande</b>  |                    |  |           |           |   |
| Netherlands 2,75% 14 - 15.01.47                               | EUR                | 3.000.000  | 0         | 0         | 3.000.000                                 |
| Netherlands 3,25% 11 - 15.07.21                               | EUR                | 1.359.000  | 0         | 0         | 1.359.000                                 |
| <b>Vereinigtes Königreich</b>                                 |                    |  |           |           |   |
| Lloyds Bank PLC 4,875% 12 -<br>30.03.27                       | GBP                | 1.000.000  | 0         | 1.000.000 | 0   |
| United Kingdom Gilt 3,50% 14 -<br>22.01.45                    | GBP                | 300.000  | 0         | 300.000   | 0   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

### 11. Transaktionen mit Verbundenen Personen für den in Hongkong vertriebenen Teilfonds

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter und der Mitglieder des Verwaltungsrats der Gesellschaft sind die im SFC-Code als solche definierten. Alle Transaktionen, die während des Berichtszeitraums zwischen dem Zugelassenen Teilfonds und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageverwaltern und den Mitgliedern des Verwaltungsrats der Gesellschaft und ihren jeweiligen Verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit und zu üblichen Geschäftsbedingungen abgewickelt.

Nach bestem Wissen und Gewissen der Verwaltungsgesellschaft und der Mitglieder des Verwaltungsrats hat der Zugelassene Teilfonds außer den nachfolgend aufgeführten keine Transaktionen mit Verbundenen Personen getätigt. Die Angaben in dieser Erläuterung betreffen nur den in Hongkong vertriebenen Teilfonds.

Es folgt eine Aufstellung der mit der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageverwaltern und den Mitgliedern des Verwaltungsrats der Gesellschaft und/oder ihren jeweiligen Verbundenen Personen getätigten Wertpapieranlagen und Währungstransaktionen:

| Teilfonds  | Währung | Summe Käufe und Verkäufe | Prozentualer Anteil der Gesamtanzahl der Transaktionen des Portfolios im Berichtszeitraum | Provisionen | Durchschnittlicher Provisionsatz (in%) |
|--|---------|--------------------------|---|-------------|--|
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF* | AUD     | 78.972.897               | 100%  | 0           | 0                                      |

Keines der Mitglieder des Verwaltungsrats der Gesellschaft oder ihre jeweiligen Verbundenen Personen profitiert/profitieren von Transaktionen mit Anteilen des Zugelassenen Teilfonds oder von der Verwaltung des Zugelassenen Teilfonds.

### 12. Soft Commissions

Weder die Verwaltungsgesellschaft noch die Anlageverwalter haben während des Berichtszeitraums mit Brokern Soft Commission-Vereinbarungen abgeschlossen.

### 13. Liste der Indexbestandteile, die mehr als 10% des in Hongkong vertriebenen Teilfonds ausmachen

Diese Erläuterung betrifft nur den in Hongkong vertriebenen Teilfonds. Nachfolgend ist für den betreffenden Zugelassenen Teilfonds der Indexbestandteil aufgeführt, der mehr als 10% des zugrunde liegenden Index ausmacht, sowie seine jeweilige Gewichtung zum 30. Juni 2016:

| Teilfonds  | Bezeichnung des Indexbestandteils | Gewichtung des Indexbestandteils |
|--|-----------------------------------|----------------------------------|
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF* | AUD Interbank Overnight Cash Rate | 100%                             |

### 14. Wertentwicklung des Teilfonds gegenüber der Wertentwicklung des Index betreffend den in Hongkong vertriebenen Teilfonds

Die Angaben in dieser Erläuterung betreffen nur den in Hongkong vertriebenen Teilfonds:

| Teilfonds  | Anteils-klasse | Wertentwicklung während des Berichtszeitraums |           | Tracking-Differenz |
|--|----------------|---|-----------|--------------------|
|  |                | Index   | Teilfonds |                    |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH UCITS ETF* | 4C             | 0,96%   | 0,86%     | (0,10)%            |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

## 15. Nachfolgende Ereignisse

1. Am 20. Mai 2016 informierte die Gesellschaft die Anteilsinhaber der folgenden Teilfonds darüber, dass die Notierung der angegebenen Anteilklassen an der Borsa Italiana mit Wirkung zum 26. August 2016 eingestellt wird:

- db x-trackers II EONIA UCITS ETF\*, 1D / LU0335044896
- db x-trackers II IBOXX GERMANY 3-5 UCITS ETF\*, 1D / LU0613540854
- db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED 1-3 UCITS ETF\*, 1C / LU0548059699
- db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF\*, 1C / LU0643975161
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF\*, 1D / LU0614173549
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF\*, 1D / LU0614173895
- db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN SHORT DAILY UCITS ETF\*, 1C / LU0952581667
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA UCITS ETF\*, 1C / LU0484969463
- db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED UCITS ETF\*, 1C / LU0321463506
- db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER 2X SHORT DAILY UCITS ETF\*, 1C / LU0613541662
- db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF\*, 1C / LU0484968812
- db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF INDONESIA GOVERNMENT UCITS ETF\*, 1C / LU0378818214
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE AAA 1-3 UCITS ETF\*, 1C / LU0613540938

2. Am 5. August 2016 informierte die Gesellschaft die Anteilsinhaber der folgenden Teilfonds darüber, dass diese ihren Anlageverwalter zwischen dem 5. September 2016 und dem 28. Februar 2017 von State Street Global Advisors Limited in Deutsche Asset Management Investment GmbH ändern werden, wobei bestimmte Portfoliomanagementaufgaben an Deutsche Asset Management (UK) Limited delegiert werden:

- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+UCITS ETF

3. Am 5. August 2016 informierte die Gesellschaft die Anteilsinhaber der folgenden Teilfonds darüber, dass diese zwischen dem 5. September 2016 und dem 28. Februar 2017 von einer Indirekten Anlagepolitik zu einer Direkten Anlagepolitik mit Optimierter Indexnachbildung wechseln werden:

- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF
- db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+UCITS ETF

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.



**15. Nachfolgende Ereignisse (Fortsetzung)**

4. Am 5. August 2016 informierte die Gesellschaft die Anteilshaber der folgenden Teilfonds darüber, dass diese zwischen dem 5. September 2016 und dem 28. Februar 2017 ihre Namen wie folgt ändern werden:

| <b>Alter Name des Teilfonds</b>                             | <b>Neuer Name des Teilfonds</b>                                |
|---|--|
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF*       | db x-trackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (DR)       |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF*   | db x-trackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF (DR)   |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF*   | db x-trackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF (DR)   |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF*   | db x-trackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF (DR)   |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF*  | db x-trackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF (DR)  |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF* | db x-trackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 10-15 UCITS ETF (DR) |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF*   | db x-trackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15+ UCITS ETF (DR)   |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+UCITS ETF*    | db x-trackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF (DR)   |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Informationen für Anteilsinhaber

### 1. Online-Veröffentlichung von Anlageportfolios, Sicherheiten und Swap-Exposure

Anteilsinhaber können unter <http://www.etf.db.com> die Swap-Exposures sowie die Anlageportfolios oder die gehaltenen Sicherheiten für jeden Teilfonds aufrufen. Die Informationen sind im Abschnitt „ETF-Informationen“ für jeden Teilfonds verfügbar.

### 2. Bestimmung des Gesamtrisikos

Bei der Methode, die für alle Teilfonds zur Berechnung des Gesamtrisikos aus dem Einsatz derivativer Finanzinstrumente eingesetzt wird, handelt es sich um den Commitment-Ansatz gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512.

### 3. Wertentwicklungstabelle und Tracking Error

Die folgende Tabelle enthält die während des ersten Geschäftshalbjahres 2016 realisierten Tracking-Errors für alle Teilfonds und/oder Anteilsklassen, die vor dem Beginn des bis zum 30. Juni 2016 endenden Berichtszeitraums aufgelegt wurden.

| Teilfonds   | Anteilsklasse | Währung | Pauschalgebühren in % | Wertentwicklung des Index | Wertentwicklung des Teilfonds/der Anteilsklasse | Differenz der Wertentwicklung | Tracking Error |
|---|---------------|---------|-----------------------|---------------------------|---|-------------------------------|----------------|
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF*       | 1C            | EUR     | 0,15%                 | 5,67%                     | 5,60%   | (0,07%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE UCITS ETF*       | 1D            | EUR     | 0,15%                 | 5,67%                     | 5,60%   | (0,07%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF*   | 1C            | EUR     | 0,15%                 | 0,29%                     | 0,21%   | (0,08%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 UCITS ETF*   | 1D            | EUR     | 0,15%                 | 0,29%                     | 0,21%   | (0,08%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF*   | 1C            | EUR     | 0,15%                 | 1,56%                     | 1,49%   | (0,07%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 3-5 UCITS ETF*   | 1D            | EUR     | 0,15%                 | 1,56%                     | 1,48%   | (0,08%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 UCITS ETF*   | 1C            | EUR     | 0,15%                 | 3,21%                     | 3,13%   | (0,08%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 7-10 UCITS ETF*  | 1C            | EUR     | 0,15%                 | 5,59%                     | 5,51%   | (0,08%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 10-15 UCITS ETF* | 1C            | EUR     | 0,15%                 | 8,46%                     | 8,37%   | (0,09%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 15+ UCITS ETF*   | 1C            | EUR     | 0,15%                 | 17,20%                    | 17,12%  | (0,08%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 25+ UCITS ETF*   | 1C            | EUR     | 0,15%                 | 22,92%                    | 22,83%  | (0,09%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*   | 1C            | EUR     | 0,25%                 | 8,28%                     | 8,15%   | (0,13%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*   | 3D            | GBP     | 0,25%                 | 9,28%                     | 9,13%   | (0,15%)                       | 0,10%          |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*   | 4D            | CHF     | 0,25%                 | 7,97%                     | 7,85%   | (0,12%)                       | 0,09%          |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*   | 2C            | USD     | 0,25%                 | 8,88%                     | 8,75%   | (0,13%)                       | 0,56%          |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*   | 1D            | EUR     | 0,25%                 | 8,28%                     | 8,16%   | (0,12%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II IBOXX GLOBAL INFLATION-LINKED UCITS ETF*   | 5C            | EUR     | 0,25%                 | 4,54%                     | 4,42%   | (0,12%)                       | 0,13%          |
| db x-trackers II IBOXX EURO INFLATION-LINKED UCITS ETF*     | 1C            | EUR     | 0,20%                 | 3,47%                     | 3,36%   | (0,11%)                       | 0,01%          |
| db x-trackers II EONIA UCITS ETF*                           | 2C            | EUR     | 0,15%                 | (0,15%)                   | (0,18%)   | (0,03%)                       | 0,04%          |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

**3. Wertentwicklungstabelle und Tracking Error (Fortsetzung)**

| Teilfonds   | Anteils-<br>klasse | Wahrung | Pau-<br>schal-<br>gebuhr<br>in% | Wertent-<br>wicklung<br>des Index | Wertentwick-<br>lung des<br>Teilfonds/der<br>Anteilsklasse | Differenz der<br>Wertentwick-<br>lung | Tracking<br>Error |
|---|--------------------|----------|----------------------------------|-----------------------------------|--|---------------------------------------|-------------------|
| db x-trackers II EONIA UCITS ETF*   | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | (0,15%)                           | (0,22%)  | (0,07%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II EONIA UCITS ETF*   | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | (0,15%)                           | (0,22%)  | (0,07%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II ITRAXX® EUROPE UCITS<br>ETF*                             | 1C                 | EUR      | 0,18%                            | (0,34%)                           | (0,43%)  | (0,09%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER<br>UCITS ETF*                          | 1C                 | EUR      | 0,24%                            | (2,77%)                           | (2,89%)  | (0,12%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II ITRAXX® EUROPE SHORT<br>DAILY UCITS ETF*                 | 1C                 | EUR      | 0,18%                            | (0,20%)                           | (0,29%)  | (0,09%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER<br>SHORT DAILY UCITS ETF*              | 1C                 | EUR      | 0,24%                            | 1,06%                             | 0,93%  | (0,13%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II EMERGING MARKETS<br>LIQUID EUROBOND UCITS ETF*           | 1C                 | EUR      | 0,55%                            | 7,46%                             | 7,19%  | (0,27%)                               | 0,48%             |
| db x-trackers II SHORT IBOXX €<br>SOVEREIGNS EUROZONE DAILY UCITS<br>ETF* | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | (5,89%)                           | (5,96%)  | (0,07%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY<br>COVERED UCITS ETF*                      | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | 2,06%                             | 1,99%  | (0,07%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY<br>COVERED UCITS ETF*                      | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | 2,06%                             | 1,99%  | (0,07%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS UCITS ETF*                                 | 1D                 | GBP      | 0,20%                            | 11,97%                            | 11,86%   | (0,11%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX UK GILT INFLATION-<br>LINKED UCITS ETF*            | 1D                 | GBP      | 0,20%                            | 18,04%                            | 17,84%   | (0,20%)                               | 0,11%             |
| db x-trackers II FED FUNDS EFFECTIVE<br>RATE UCITS ETF*                   | 1C                 | USD      | 0,15%                            | 0,18%                             | 0,11%  | (0,07%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II STERLING CASH UCITS ETF*                                 | 1D                 | GBP      | 0,15%                            | 0,23%                             | 0,15%  | (0,08%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS<br>ETF*                           | 1C                 | EUR      | 0,25%                            | 6,23%                             | 6,10%  | (0,13%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS<br>ETF*                           | 1D                 | EUR      | 0,25%                            | 6,23%                             | 6,10%  | (0,13%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS<br>ETF*                           | 2D                 | GBP      | 0,25%                            | 7,03%                             | 6,90%  | (0,13%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS<br>ETF*                           | 4C                 | CHF      | 0,25%                            | 5,87%                             | 5,74%  | (0,13%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II GLOBAL SOVEREIGN UCITS<br>ETF*                           | 5C                 | EUR      | 0,25%                            | 8,79%                             | 8,66%  | (0,13%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF<br>INDONESIA GOVERNMENT UCITS ETF*      | 1C                 | USD      | 0,40%                            | 18,03%                            | 17,62%   | (0,41%)                               | 0,09%             |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF<br>SINGAPORE GOVERNMENT UCITS ETF*      | 1C                 | SGD      | 0,20%                            | 4,92%                             | 4,82%  | (0,10%)                               | 0,05%             |
| db x-trackers II SINGAPORE DOLLAR CASH<br>UCITS ETF*                      | 1C                 | SGD      | 0,15%                            | 0,13%                             | 0,06%  | (0,07%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II IBOXX £ GILTS 1-5 UCITS<br>ETF*                          | 1D                 | GBP      | 0,20%                            | 2,86%                             | 2,76%  | (0,10%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES UCITS<br>ETF (DR)                    | 1D                 | USD      | 0,15%                            | 5,77%                             | 5,69%  | (0,08%)                               | 0,05%             |
| db x-trackers II UK GILTS SHORT DAILY<br>UCITS ETF*                       | 1C                 | GBP      | 0,25%                            | (10,82%)                          | (10,93%)   | (0,11%)                               | 0,07%             |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES<br>INFLATION-LINKED UCITS ETF (DR)   | 1D                 | USD      | 0,20%                            | 6,65%                             | 6,53%  | (0,12%)                               | 0,07%             |
| db x-trackers II US TREASURIES SHORT<br>DAILY UCITS ETF*                  | 1C                 | USD      | 0,25%                            | (5,31%)                           | (5,42%)  | (0,11%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II IBOXX \$ TREASURIES 1-3<br>UCITS ETF (DR)                | 1D                 | USD      | 0,15%                            | 1,39%                             | 1,30%  | (0,09%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID<br>CORPORATE UCITS ETF*                 | 1C                 | EUR      | 0,20%                            | 3,07%                             | 2,97%  | (0,10%)                               | 0,06%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID<br>CORPORATE UCITS ETF*                 | 2C                 | EUR      | 0,20%                            | (0,03%)                           | (0,13%)  | (0,10%)                               | 0,07%             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Informationen für Anteilssinhaber (Fortsetzung)

**3. Wertentwicklungstabelle und Tracking Error (Fortsetzung)**

| Teilfonds   | Anteils-<br>klasse | Wahrung | Pau-<br>schal-<br>gebuhr<br>in% | Wertent-<br>wicklung<br>des Index | Wertentwick-<br>lung des<br>Teilfonds/der<br>Anteilsklasse | Differenz der<br>Wertentwick-<br>lung | Tracking<br>Error |
|---|--------------------|----------|----------------------------------|-----------------------------------|--|---------------------------------------|-------------------|
| db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF*                                       | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | 6,76%                             | 6,68%  | (0,08%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY UCITS ETF*                                       | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | 6,76%                             | 6,68%  | (0,08%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 1-3 UCITS<br>ETF*                                | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | 0,33%                             | 0,25%  | (0,08%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX ABF KOREA<br>GOVERNMENT UCITS ETF*                | 1C                 | USD      | 0,20%                            | 6,41%                             | 6,31%  | (0,10%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID<br>CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF*            | 1C                 | EUR      | 0,20%                            | 1,40%                             | 1,29%  | (0,11%)                               | 0,05%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID<br>CORPORATE FINANCIALS UCITS ETF*            | 2C                 | EUR      | 0,20%                            | (1,10%)                           | (1,20%)  | (0,10%)                               | 0,05%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID<br>CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF*        | 1C                 | EUR      | 0,20%                            | 4,40%                             | 4,26%  | (0,14%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID<br>CORPORATE NON-FINANCIALS UCITS ETF*        | 2C                 | EUR      | 0,20%                            | 0,80%                             | 0,69%  | (0,11%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS<br>EUROZONE AAA UCITS ETF*                    | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | 6,76%                             | 6,68%  | (0,08%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS<br>EUROZONE AAA UCITS ETF*                    | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | 6,76%                             | 6,69%  | (0,07%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS<br>EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF*             | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | 4,35%                             | 4,27%  | (0,08%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS<br>EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF*             | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | 4,35%                             | 4,27%  | (0,08%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS<br>EUROZONE YIELD PLUS UCITS ETF*             | 2C                 | EUR      | 0,15%                            | (1,02%)                           | (1,10%)  | (0,08%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH<br>UCITS ETF*                           | 1C                 | AUD      | 0,20%                            | 0,96%                             | 0,86%  | (0,10%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH<br>UCITS ETF*                           | 2C                 | AUD      | 0,20%                            | 0,96%                             | 0,86%  | (0,10%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH<br>UCITS ETF*                           | 3C                 | AUD      | 0,20%                            | 0,96%                             | 0,86%  | (0,10%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II AUSTRALIAN DOLLAR CASH<br>UCITS ETF*                           | 4C                 | AUD      | 0,20%                            | 0,96%                             | 0,86%  | (0,10%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II AUSTRALIA SSA BONDS UCITS<br>ETF*                              | 1C                 | AUD      | 0,25%                            | 5,51%                             | 5,38%  | (0,13%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY COVERED 1-3<br>UCITS ETF*                        | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | 0,31%                             | 0,23%  | (0,08%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II ITRAXX® CROSSOVER 2X<br>SHORT DAILY UCITS ETF*                 | 1C                 | EUR      | 0,34%                            | 1,78%                             | 1,61%  | (0,17%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II IBOXX GBP LIQUID<br>CORPORATE UCITS ETF*                       | 1D                 | GBP      | 0,20%                            | 8,67%                             | 8,54%  | (0,13%)                               | 0,06%             |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BOT<br>UCITS ETF*                         | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | 0,01%                             | (0,07%)  | (0,08%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY<br>AGGREGATE UCITS ETF*                   | 1D                 | EUR      | 0,20%                            | 2,46%                             | 2,35%  | (0,11%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II MTS EX-BANK OF ITALY BTP<br>UCITS ETF*                         | 1D                 | EUR      | 0,20%                            | 2,91%                             | 2,81%  | (0,10%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 3-5 UCITS<br>ETF*                                | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | 1,63%                             | 1,55%  | (0,08%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS<br>EUROZONE AAA 1-3 UCITS ETF*                | 1C                 | EUR      | 0,15%                            | 0,32%                             | 0,25%  | (0,07%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX GERMANY 7-10 UCITS<br>ETF*                               | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | 6,15%                             | 6,07%  | (0,08%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR LIQUID COVERED<br>UCITS ETF*                         | 1C                 | EUR      | 0,20%                            | 4,06%                             | 3,95%  | (0,11%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 1-3<br>YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | 1D                 | EUR      | 0,15%                            | 0,22%                             | 0,14%  | (0,08%)                               | 0,11%             |

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Informationen für Anteilsinhaber (Fortsetzung)

**3. Wertentwicklungstabelle und Tracking Error (Fortsetzung)**

| Teilfonds  | Anteils-<br>klasse | Währung | Pauschal-<br>gebühr<br>in% | Wertent-<br>wicklung<br>des Index | Wertentwick-<br>lung des<br>Teilfonds/der<br>Anteilsklasse | Differenz der<br>Wertentwick-<br>lung | Tracking<br>Error |
|--|--------------------|---------|----------------------------|-----------------------------------|--|---------------------------------------|-------------------|
| db x-trackers II MTS ITALY AGGREGATE 3-5 YEARS - EX-BANK OF ITALY UCITS ETF* | 1D                 | EUR     | 0,20%                      | 1,28%                             | 1,18%  | (0,10%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II CANADIAN DOLLAR CASH UCITS ETF*                             | 1C                 | CAD     | 0,20%                      | 0,26%                             | 0,16%  | (0,10%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF*         | 1C                 | EUR     | 0,15%                      | 0,29%                             | 0,22%  | (0,07%)                               | 0,05%             |
| db x-trackers II IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF*         | 1D                 | EUR     | 0,15%                      | 0,29%                             | 0,22%  | (0,07%)                               | 0,05%             |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN UCITS ETF*                                      | 1C                 | EUR     | 0,20%                      | 4,91%                             | 4,80%  | (0,11%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II IBOXX SPAIN 1-3 UCITS ETF*                                  | 1C                 | EUR     | 0,15%                      | 0,50%                             | 0,43%  | (0,07%)                               | 0,04%             |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN UCITS ETF*                     | 1C                 | JPY     | 0,15%                      | 7,38%                             | 7,30%  | (0,08%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II MARKIT IBOXX JAPAN SOVEREIGN SHORT DAILY UCITS ETF*         | 1C                 | JPY     | 0,25%                      | (7,16%)                           | (7,28%)  | (0,12%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*                   | 1D                 | USD     | 0,30%                      | 8,96%                             | 8,74%  | (0,22%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*                   | 2C                 | USD     | 0,30%                      | 5,87%                             | 5,71%  | (0,16%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*                   | 3D                 | GBP     | 0,30%                      | 2,32%                             | 2,26%  | (0,06%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*                   | 4C                 | CHF     | 0,30%                      | 4,96%                             | 4,80%  | (0,16%)                               | 0,02%             |
| db x-trackers II BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF*                   | 5C                 | EUR     | 0,30%                      | 5,30%                             | 5,14%  | (0,16%)                               | 0,03%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND UCITS ETF*                        | 1D                 | EUR     | 0,35%                      | 3,07%                             | 2,89%  | (0,18%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND SHORT DAILY UCITS ETF*            | 1C                 | EUR     | 0,35%                      | (3,96%)                           | (4,12%)  | (0,16%)                               | 0,01%             |
| db x-trackers II IBOXX EUR HIGH YIELD BOND 1-3 UCITS ETF*                    | 1D                 | EUR     | 0,35%                      | 2,35%                             | 2,18%  | (0,17%)                               | 0,06%             |
| db x-trackers II HARVEST CSI CHINA SOVEREIGN BOND UCITS ETF (DR)             | 1D                 | USD     | 0,55%                      | (0,69%)                           | (1,00%)  | (0,31%)                               | 1,92%             |

**4. Wichtige Ereignisse während des Berichtszeitraums**

1. Am 10. März 2016 informierte die Gesellschaft die Anteilsinhaber der Gesellschaft in Bezug auf jeden Teilfonds, der ein Fonds mit Indirekter Replikation ist und Geschäfte mit Unfunded Swaps eingeht, dass sie beschlossen hat, dass die Flexibilität zum Abschluss von OTC-Swap-Transaktionen mit anderen Kontrahenten als der Deutsche Bank gegeben sein soll, vorausgesetzt, es handelt sich um zulässige Kontrahenten, die die von der Verwaltungsgesellschaft und den Vorschriften auferlegten Anforderungen erfüllen. Eine Liste dieser Swap-Kontrahenten ist auf der Webseite der Gesellschaft <http://www.etf.db.com> verfügbar.

2. Am 16. März 2016 informierte die Gesellschaft die Anteilsinhaber über die Änderung des Namens der Verwaltungsgesellschaft von „Deutsche Asset & Wealth Management Investment S.A.“ in „Deutsche Asset Management S.A.“ und des Anlageverwalters bestimmter Teilfonds von „Deutsche Asset & Wealth Management Investment GmbH“ in „Deutsche Asset Management Investment GmbH“, jeweils zum 17. März 2016.

**5. Von der Verwaltungsgesellschaft verwaltete Investmentfonds**

Zum 30. Juni 2016 erbringt die Verwaltungsgesellschaft Anlageverwaltungsdienstleistungen für die folgenden Investmentfonds:

a) in der Rechtsform eines Fonds Commun de Placement (FCP) nach Luxemburger Recht:

|  |  |
|--|--|
| AL DWS GlobalAktiv <sup>+</sup><br>ARERO – Der Weltfonds<br>Bethmann Absolute Flex International<br>Bethmann Vermögensverwaltung Ausgewogen<br>Bethmann Vermögensverwaltung Ertrag | DWS G-SIFIs Hybrid Bond Fund<br>DWS Global Value<br>DWS Gold plus<br>DWS India<br>DWS Megatrend Performance 2016 |
|--|--|

\* Dies ist ein synthetischer ETF.

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Informationen für Anteilinhaber (Fortsetzung)

**5. Von der Verwaltungsgesellschaft verwaltete Investmentfonds (Fortsetzung)**

a) in der Rechtsform eines Fonds Commun de Placement (FCP) nach Luxemburger Recht: (Fortsetzung)

|  |  |
|--|--|
| Bethmann Vermögensverwaltung Wachstum<br>Breisgau-Fonds<br>DB Advisors Emerging Markets Equities – Passive<br>DB Advisors Invest<br>DB Advisors Strategy Fund<br>DB Fixed Coupon Fund 2018<br>DB Fixed Coupon Fund 2018 II<br>DB Opportunity<br>DB Portfolio<br>Deutsche Bank Zins & Dividende<br>Deutsche European Real Estate Securities Master Fund<br>Deutsche Floating Rate Notes<br>Deutsche Floating Rates Notes (USD)<br>Deutsche Multi Opportunities<br>DWS Concept ARTS Conservative<br>DWS Concept ARTS Dynamic<br>DWS Concept ARTS Balanced<br>DWS Concept DJE Alpha Renten Global<br>DWS Dividende Direkt 2017<br>DWS Dividende Garant 2016<br>DWS Emerging Corporate Bond Master Fund<br>DWS Emerging Markets Bonds (Short)<br>DWS Emerging Sovereign Bond Fund AUD<br>DWS Emerging Sovereign Bond Fund USD<br>DWS Emerging Sovereign Bond Fund USD (AUD)<br>DWS Euro Reserve<br>DWS Euro-Bonds (Long)<br>DWS Euro-Bonds (Medium)<br>DWS Eurorenta<br>DWS Etoile<br>DWS Garant 80 FPI<br>DWS Global<br>DWS Global Equity Focus Fund<br>DWS Global Utility Bond Master Fund | DWS Osteuropa<br>DWS Performance Rainbow 2015<br>DWS Rendite<br>DWS Rendite Optima<br>DWS Rendite Optima Four Seasons<br>DWS Russia<br>DWS Top Balance<br>DWS Top Dynamic<br>DWS Top Portfolio Balance<br>DWS Top Portfolio Defensiv<br>DWS Türkei<br>DWS Vermögensbildungsfonds I (Lux)<br>DWS Vermögensmandat<br>DWS Vola Strategy<br>DWS Vorsorge<br>DWS World Funds<br>DWS Zeitwert Protect<br>Global Emerging Markets Balance Portfolio<br>Multi Opportunities<br>Multi Opportunities III<br>Multi Style – Mars<br>Oona Solutions<br>PAM International Fund Selection Portfolio<br>Postbank Dynamik<br>Postbank Strategie<br>SFC Global Markets<br>SOP CorporateBonds TotalReturn<br>Südwestbank Vermögensmandat<br>Vermögensfondsmandat flexibel (80% teilgeschützt)<br>Zurich<br>Zurich Vorsorge Dachfonds II |
|--|--|

b) in der Rechtsform einer SICAV nach Luxemburger Recht:

|   |   |
|---|---|
| Corporate II<br>Corporate III<br>DB Advisors<br>DB Advisory Multibrands<br>DB<br>db PrivatMandat Comfort<br>DeAWM Fixed Maturity<br>db PBC<br>DB Platinum<br>DB Platinum II<br>DB Platinum IV<br>DB PWM | db x-trackers***<br>db x-trackers II**<br>Deutsche Institutional<br>Deutsche Invest I (DWS Invest)<br>Deutsche Invest II (DWS Invest II)<br>DWS Garant<br>DWS Funds<br>Deutsche Concept<br>DWS FlexPension<br>DWS Select<br>Polar Investments<br>PWM Vermögensfondsmandat – DWS |
|---|---|

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.

Informationen für Anteilshaber (Fortsetzung)

**5. Von der Verwaltungsgesellschaft verwaltete Investmentfonds (Fortsetzung)**

- c) in der Form eines Specialised Investment Fund (SIF) nach Luxemburger Recht, in der Rechtsform eines SICAV-SIF oder FCP-SIF:

|   |  |
|---|--|
| Capital Strategies International Fund<br>Corporate XII<br>DWS Brazil Bond Fund<br>DWS China A-Fund<br>DWS Emerging New Deal Fund<br>DWS Emerging Sovereign Bond Master Fund | DWS Euro High Yield Bond Master Fund<br>DWS RREEF Global Real Estate Securities Master Fund<br>DWS Russia Bond Fund<br>Energy Revolution |
|---|--|

- d) in der Rechtsform eines Trust nach dem Recht der Cayman-Inseln:

|                       |
|-----------------------|
| Palladium Japan Trust |
|-----------------------|

\*\* Umfasst auch synthetische ETF.