

27 november 2024

Publicering enligt SFDR - Sammanfattning

Xtrackers MSCI World High Dividend Yield ESG UCITS ETF

Denna finansiella produkt främjar miljömässiga och sociala egenskaper och kvalificeras som produkt i enlighet med artikel 8.1 i förordning (EU) 2019/2088.

Versaliserade termer som används i detta dokument ska ha samma innebörd som tillskrivs dem i den senaste versionen av Bolagets prospekt ("Prospektet"), om inte sammanhanget kräver något annat. Detta upplysningsdokument tillhandahålls i sammanfattande form, för mer detaljerad information se prospektet eller dokumentet med titeln "Publication enligt SFDR – Detaljer", tillgängligt på den finansiella produktens webbplats på www.Xtrackers.com.

Inget hållbart investeringsmål

Denna finansiella produkt främjar miljömässiga eller sociala egenskaper, men har inte som mål hållbar investering.

Den finansiella produkten förbinder sig att delvis investera i hållbara investeringar. Investeringar som inte uppfyller DWS:s DNSH-trösklar kommer inte att beaktas för den hållbara investeringsandelen av den finansiella produkten. Detta inkluderar, men är inte begränsat till, inblandning i skadlig affärsverksamhet, brott mot internationella normer eller inblandning i mycket allvarliga kontroverser, samt överträdelse av vissa trösklar för huvudsakliga negativa indikatorer.

Som en del av DNSH-bedömningen inkluderar referensindexet för den finansiella produkten (enligt definitionen nedan) kriterier för att minska exponeringen mot, eller för att utesluta värdepapper som är negativt anpassade till, vissa huvudsakliga negativa indikatorer, enligt definitionen i den prekontraktuella informationen för den finansiella produkten.

Alla värdepapper som bryter mot OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter utesluts av den finansiella produktens referensindikator.

Miljömässiga eller sociala egenskaper hos den finansiella produkten

Den finansiella produkten främjar miljömässiga och sociala egenskaper och kvalificerar sig som en finansiell produkt som omfattas av artikel 8 (1) SFDR genom att följa referensindexet som inkluderar miljömässiga och/eller sociala hänsyn. Den finansiella produkten har en portfölj av aktievärdepapper som omfattar alla, eller ett betydande antal av, de värdepapper som ingår i referensindexet. För att vara berättigade att innefattas av referensindexet måste aktier ingå som beståndsdelar i Moderindexet (enligt definitionen nedan) och uppfylla vissa ESG-screeningskriterier (Environmental, Social and Governance, dvs. miljö, samhälle och bolagsstyrning). Referensindexet utesluter företag från Moderindexet, som: (i) är utan betyg av MSCI ESG Research, (ii) tilldelas ett MSCI ESG-betyg på CCC, (iii) har någon inblandning i kontroversiella vapen, (iv) är klassificerade av MSCI i deras undersökning av affärsinvolvering eller klimatförändringsstatistik som att bryta mot vissa intäktsströklar i kontroversiell verksamhet, inklusive, men inte begränsat till, civila skjutvapen, kärnvapen, tobak, vuxenunderhållning, alkohol, konventionella vapen, spel, genetiskt modifierade organismer, kärnkraft, innehav av fossila bränslereserver, utvinning av fossila bränslen och gas, samt elproduktion, och (v) inte följer FN:s Global Compact-principer, har ett MSCI Controversies Score på 0 eller har ett otillräckligt MSCI ESG Controversies Score kopplat till vissa miljörelaterade kontroverser. Värdepapper från moderindexet som uppfyller tidigare nämnda kriterier kommer att utgöra det valbara universumet. Referensindexet tillämpar vissa urvals- och

viktning begränsningar i förhållande till moderindex. Värdepapper från det valbara universumet väljs ut och viktas enligt en optimeringsbaserad strategi (inklusive optimering för höga utdelningsavkastningar) som omfattar (a) klimat (såsom minimivärden för relativa reduceringar i exponering mot fossilbränslesektorn och växthusgaser, vattenutsläpp och utsläpp av farligt avfall) och ESG-mål, samt (b) spridnings- och faktormål i relation till exempelvis säkerhets-, bransch- och landsvikt. ESG-kriterierna omfattar de krav som anges i Artikel 12(1)(a) till (g) i Kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 (PAB-undantag).

Investeringsstrategi

Den finansiella produktens investeringsmål är att följa resultatet, före avgifter och kostnader, för "referensindexet", som är MSCI World High Dividend Yield Low Carbon SRI Screened Select Index. Referensindexet är utformat för att återspegla resultatet för stora och medelstora företag på globala utvecklade marknader med fokus på att maximera exponeringen mot utdelningsavkastningsfaktorn och som uppfyller vissa kriterier avseende miljö, samhälle och bolagsstyrning (ESG). Referensindexet är baserat på MSCI World Index ("föräldraindexet"). Moderindexet återspeglar resultatet för stora och medelstora företag på globala utvecklade marknader. Referensindexet exkluderar företag från moderindex som inte uppfyller vissa ESG-kriterier (miljö, social och styrning). För att bedöma god förvaltningspraxis för de företag som har investerats i, utesluter referensindexet företag som enligt MSCI ESG Controversies-data har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser (inklusive kontroverser kring styrning), samt företag vars ISS ESG-betyg (som bland annat bedömer hur väl företag hanterar styrningsrisker och möjligheter) ligger under ett angivet tröskelvärde eller inte har tilldelats ett ISS ESG-betyg.

Andel investeringar

Den här finansiella produkten investerar minst 90% av sina nettotillgångar i investeringar som är i linje med de miljömässiga och sociala egenskaper som främjas. Inom denna kategori kvalificerar minst 10% av den finansiella produktens tillgångar som hållbara investeringar enligt definitionen i artikel 2 (17) SFDR. Upp till 10% av investeringarna är inte i linje med dessa miljömässiga eller sociala egenskaper. En mer detaljerad beskrivning av den specifika tillgångsallokeringen för denna finansiella produkt finns i prospektet. Finansiella derivatinstrument kan användas som kompletterande investeringar för en effektiv portföljförvaltning.

Övervakning av miljömässiga eller sociala egenskaper

Referensindexet tillämpar ESG-kriterierna ovan. DWS utför regelbundet en oberoende verifiering av referensindexets ESG-

kriterier, med två nyckelelement: (i) att sammansättningen av den finansiella produktens portfölj är nära anpassad till referensindexets ESG-standarder, och (ii) att referensindexet tillämpar de angivna ESG-kriterierna korrekt.

Investorerna bör notera att även om den finansiella produkten och referensindexet strävar efter att säkerställa överensstämmelse med sådana kriterier vid varje ombalanserings- eller granskningsdatum, mellan dessa granskningar eller ombalanseringar, kan värdepapper som inte längre uppfyller dessa kriterier förbli inkluderade i (i) referensindexet tills de tas bort vid efterföljande ombalansering eller översyn eller (ii) portföljen av den finansiella produkten tills det är möjligt och genomförbart att avyttra sådana positioner.

Metoder

Uppnåendet av de miljömässiga och sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten mäts med hjälp av följande hållbarhetsindikatorer:

- Exponering mot mycket allvarliga kontroverser
- Exponering mot worst-in-class-emittenter
- Inblandning i kontroversiella vapen
- Växthusgasintensitet
- Exponering mot fossila bränslen

Mer information om dessa hållbarhetsindikatorer finns i prospektet.

Datakällor och bearbetning

Referensindexet använder data från olika produkter som tillhandahålls av MSCI ESG Research LLC. Dessa produkter inkluderar MSCI ESG Ratings, MSCI ESG BISR, MSCI ESG Controversies Scores and MSCI Climate Change Metrics.

Begränsningar för metoder och data

Referensindexets ESG-standarder begränsar antalet värdepapper som kan ingå i referensindexet. Som ett resultat kan referensindexet, och som sådan den finansiella produkten, vara mer koncentrerad och underprestera marknaden som helhet eller underprestera andra fonder som screenats för miljömässiga, sociala och styrningsstandarder, eller som inte screenar för sådana standarder. Referensindexet bygger enbart på analys från Indexadministratören eller andra dataleverantörer (i tillämpliga fall) i relation till hållbarhetsaspekter. Varken bolaget eller någon av dess tjänsteleverantörer gör något påstående med avseende på noggrannheten, tillförlitligheten, riktigheten av hållbarhetsrelaterade data eller hur dessa implementeras.

Företagsbesiktning

När det gäller valet av eventuella nya referensindex för Xtrackers ETF:er kommer DWS att genomföra en företagsbesiktning som inkluderar bedömning av hållbarhetsrisker och som strävar efter att samarbeta med leverantörer av jämförelseindex för att integrera vissa hållbarhetsrisker i konstruktionen av nya index för nya finansiella produkter, samt referensindex som anses vara ett potentiellt referensindex vid ersättning av en befintlig finansiell produkt. Som en del av denna process kommer miniminormer för ESG att tillämpas.

Åtagandepolicyer

Aktivt engagemang med våra emittenter där vi investerar, genom att använda proxyröstning och engagemang för att driva förändringar till förmån för kunderna är en viktig del av DWS Groups strategi för hållbara investeringar. DWS tillämpar en åtagandepolicy och en policy för bolagsstyrning och fullmaktsröstning.

Utsett referensriktmärke

Den finansiella produkten har utsett MSCI World High Dividend Yield Low Carbon SRI Screened Select Index som referensindex. Ytterligare information om referensindexet finns på <http://www.msci.com>.

Viktig information

MSCI Inc. och dess dotterbolag (MSCI) har exklusiv äganderätt till MSCI-indexen och de får inte kopieras eller extraheras och användas för något annat syfte utan MSCI:s samtycke. Fonden stöds inte av och är inte godkänd eller marknadsförd av MSCI, och MSCI bär inget ansvar

gentemot fonden eller eventuellt index som en sådan fond bygger på. MSCI-indexen tillhandahålls utan några som helst garantier.
© DWS Investments UK Limited 2024.