

29.11.2024

# Veröffentlichung gemäß SFDR - Zusammenfassung

## Xtrackers EUR High Yield Corporate Bond SRI PAB UCITS ETF

Dieses Finanzprodukt fördert ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen für ein Produkt gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088.

In diesem Dokument verwendete Begriffe haben die ihnen in der aktuellen Version des Prospekts der Gesellschaft (der „Prospekt“) zugewiesene Bedeutung, sofern sich aus dem Zusammenhang nichts anderes ergibt. Dieses Offenlegungsdokument wird in zusammengefasster Form zur Verfügung gestellt. Ausführlichere Informationen entnehmen Sie bitte dem Prospekt oder dem Dokument mit dem Titel „*Veröffentlichung gemäß SFDR - Details*“, das auf der Webseite des Finanzprodukts unter [www.Xtrackers.com](http://www.Xtrackers.com) verfügbar ist.

### Kein nachhaltiges Anlageziel

Dieses Finanzprodukt fördert ökologische oder soziale Merkmale, hat jedoch kein Ziel einer nachhaltigen Anlage. Das Finanzprodukt verpflichtet sich, teilweise in nachhaltige Anlagen zu investieren. Anlagen, die die Schwellenwerte in Bezug auf die Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen (Do No Significant Harm, „DNSH“) von DWS nicht einhalten, werden nicht auf den Anteil nachhaltiger Anlagen des Finanzprodukts angerechnet. Dazu gehören unter anderem die Beteiligung an schädlichen Geschäftstätigkeiten, der Verstoß gegen internationale Normen oder die Beteiligung an sehr schwerwiegenden Kontroversen sowie der Verstoß gegen bestimmte Schwellenwerte für Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen. Im Rahmen der DNSH-Bewertung bezieht der Referenzindex des Finanzprodukts (wie nachstehend definiert) Kriterien zur Reduzierung des Engagements in oder zum Ausschluss von Wertpapieren ein, die negativ auf bestimmte Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen ausgerichtet sind, wie in den vorvertraglichen Informationen für das Finanzprodukt definiert. Wertpapiere, die gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstoßen, werden vom Referenzindex des Finanzprodukts ausgeschlossen.

### Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen für ein Finanzprodukt, das Artikel 8(1) der SFDR unterliegt, indem es den Referenzindex abbildet, der ökologische und/oder soziale Erwägungen einbezieht. Das Finanzprodukt hält ein Portfolio von Wertpapieren, das alle oder einen Teil der im Referenzindex enthaltenen Wertpapiere oder nicht damit in

Zusammenhang stehende übertragbare Wertpapiere oder andere geeignete Vermögenswerte umfasst. Der Referenzindex wendet die in der Verordnung für Paris-abgestimmte EU-Referenzwerte (EU PAB, EU Paris-aligned Benchmarks) festgelegten Mindeststandards an, indem er eine anfängliche Reduzierung der absoluten Treibhausgasemissionen („THG-Emissionen“) um 50 % im Vergleich zum Bloomberg Euro High Yield 250mn Index (der „Ausgangs-Index“) vorsieht, gefolgt von einer jährlichen Reduzierung der absoluten THG-Emissionen um 7 %. Darüber hinaus schließt der Referenzindex Anleihen aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die bestimmte Kriterien in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung nicht erfüllen, darunter: (i) Emittenten, für die MSCI keine gemeldeten oder geschätzten absoluten Treibhausgasemissionsdaten vorliegen (ii) Wertpapiere, die kein Rating von MSCI ESG Research LLC erhalten haben, (iii) Emittenten mit einem Rating von BB oder niedriger, (iv) Emittenten mit einem „roten“ MSCI ESG Controversies Score oder Emittenten, die einen MSCI Environmental Controversy Score verletzen, (v) Emittenten, die im Business Involvement Screening Research von MSCI bestimmte Schwellenwerte für Umsatzerlöse im Bereich kontroverser Aktivitäten überschreiten, und (vi) Emittenten mit Engagement in umstrittenen Waffen oder fossilen Brennstoffreserven.

### Anlagestrategie

Das Anlageziel des Finanzprodukts besteht darin, die Wertentwicklung vor Gebühren und Aufwendungen des „Referenzindex“ (Bloomberg MSCI Euro High Yield Sustainable and SRI PAB Index) abzubilden. Der Referenzindex bildet seinerseits die Wertentwicklung von auf Euro lautenden High-Yield-Unternehmensanleihen ab, die bestimmte Kriterien in Bezug auf Fälligkeit, Bonität, Liquidität und ESG erfüllen. Der Referenzindex berücksichtigt die oben genannten und im Prospekt näher beschriebenen ESG-Merkmale. Zur Beurteilung der

Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, schließt der Referenzindex Unternehmen mit sehr schwerwiegenden Kontroversen (einschließlich Kontroversen in Bezug auf die Unternehmensführung) unter Verwendung der MSCI ESG Controversies-Daten sowie Unternehmen, deren MSCI ESG-Rating (mit dem u. a. bewertet wird, wie gut Unternehmen mit Risiken und Chancen in Bezug auf die Unternehmensführung umgehen) unter einem bestimmten Schwellenwert liegt oder für die kein MSCI ESG-Rating vorliegt, aus.

### **Allokation der Anlagen**

Dieses Finanzprodukt investiert mindestens 90 % seines Nettovermögens in Investitionen, die auf die geförderten ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet sind. Innerhalb dieser Kategorie sind mindestens 5 % der Vermögenswerte des Finanzprodukts als nachhaltige Investitionen gemäß Artikel 2(17) der SFDR eingestuft. Bis zu 10 % der Investitionen sind nicht auf diese ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der Prospekt enthält eine ausführlichere Beschreibung der spezifischen Vermögensallokation dieses Finanzprodukts. Derivative Finanzinstrumente können als ergänzende Anlagen für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden.

### **Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale**

Der Referenzindex wendet die oben beschriebenen ESG-Kriterien an. DWS führt eine regelmäßige unabhängige Prüfung der ESG-Legitimation des Referenzindex durch, wobei zwei Kernelemente berücksichtigt werden: (i) dass die Zusammensetzung des Portfolios des Finanzprodukts eng an den ESG-Standards des Referenzindex ausgerichtet ist und (ii) dass der Referenzindex die angegebenen ESG-Kriterien korrekt anwendet. Anleger sollten beachten, dass das Finanzprodukt und der Referenzindex zwar bestrebt sind, die Einhaltung dieser Kriterien zu jedem Anpassungs- oder Überprüfungsdatum sicherzustellen, dass jedoch zwischen diesen Überprüfungen oder Anpassungen Wertpapiere, die diese Kriterien nicht mehr erfüllen, (i) im Referenzindex enthalten bleiben können, bis sie bei der nachfolgenden Anpassung oder Überprüfung entfernt werden, oder (ii) im Portfolio des Finanzprodukts enthalten bleiben können, bis es möglich und praktikabel ist, diese Positionen zu veräußern.

### **Methoden**

Die Erreichung der durch das Finanzprodukt geförderten ökologischen und sozialen Merkmale wird anhand der folgenden Nachhaltigkeitskennzahlen gemessen:

- THG-Emissionen insgesamt
- Engagement in fossilen Brennstoffen
- Engagement in sehr schwerwiegenden Kontroversen
- Engagement in Worst-in-Class-Emittenten

Weitere Einzelheiten zu diesen Nachhaltigkeitsindikatoren sind dem Prospekt zu entnehmen.

### **Datenquellen und Datenverarbeitung**

Internetseite mit Produktinformationen gemäß Artikel 10(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 für Finanzprodukte, auf die in Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 Bezug genommen wird.

Der Referenzindex verwendet Daten von verschiedenen Produkten, die von MSCI ESG Research LLC bereitgestellt werden. Zu diesen Produkten gehören MSCI ESG Ratings, MSCI ESG BISR und MSCI ESG Controversies Scores.

### **Einschränkungen bei Methoden und Daten**

Die ESG-Standards des Referenzindex begrenzen die Zahl der Wertpapiere, die für eine Aufnahme in den Referenzindex in Frage kommen. Dementsprechend kann der Referenzindex und somit auch das Finanzprodukt stärker konzentriert sein und gegenüber dem Gesamtmarkt oder gegenüber anderen, auf ESG-Standards geprüften oder nicht auf diese Standards geprüften Fonds eine schwächere Wertentwicklung aufweisen.

Der Referenzindex stützt sich im Hinblick auf Nachhaltigkeitserwägungen ausschließlich auf die vom Index-Administrator bzw. von anderen Datenanbietern durchgeführte Analyse. Weder die Gesellschaft noch ihre Dienstleister geben irgendwelche Zusicherungen im Hinblick auf die Genauigkeit, Verlässlichkeit und Richtigkeit der nachhaltigkeitsbezogenen Daten oder der Art ihrer Umsetzung ab.

### **Sorgfaltsprüfung (Due Diligence)**

Im Hinblick auf die Auswahl neuer Referenzindizes für Xtrackers ETFs führt DWS einen Due-Diligence-Prozess durch, der die Beurteilung von Nachhaltigkeitsrisiken umfasst, und die Gesellschaft ist bemüht, mit Benchmark-Anbietern zusammenzuarbeiten, um bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken in die Zusammensetzung neuer Indizes sowohl für neue Finanzprodukte als auch im Hinblick auf Referenzindizes einfließen zu lassen, die im Falle der Ersetzung für ein bestehendes Finanzprodukt als Referenzindizes in Betracht gezogen werden könnten. Im Rahmen dieses Prozesses werden die ESG-Mindeststandards angewendet.

### **Engagement-Richtlinien**

Ein aktives Engagement bei den Unternehmen, in die wir investieren, wobei wir einen aktiven Dialog nutzen, um einen positiven Wandel zugunsten der Kunden zu bewirken, ist ein wesentlicher Bestandteil des Ansatzes der DWS-Gruppe in Bezug auf nachhaltiges Investment. DWS wendet eine Engagement-Richtlinie und eine Corporate Governance- und Stimmrechtsausübungsrichtlinie an.

### **Festgelegter Referenzwert**

Referenzwert des Finanzprodukts ist der Bloomberg MSCI Euro High Yield Sustainable and SRI PAB Index. Weitere Informationen zum Referenzindex können auf <https://www.bloombergindices.com> abgerufen werden.

### **Wichtige Informationen**

„Bloomberg®“ und der Bloomberg MSCI Euro High Yield Sustainable and SRI PAB Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren verbundenen Unternehmen, einschließlich Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Index-Administrator (zusammen „Bloomberg“), und wurden für bestimmte Zwecke von der Xtrackers (IE) plc lizenziert. Bloomberg ist nicht mit der Xtrackers (IE) plc verbunden, und Bloomberg genehmigt, unterstützt, prüft oder empfiehlt den Xtrackers EUR High Yield Corporate Bond SRI PAB UCITS ETF nicht. Bloomberg übernimmt keine Garantie für die Aktualität, Richtigkeit oder Vollständigkeit irgendwelcher Daten oder Informationen in Bezug auf den Xtrackers EUR High Yield Corporate Bond SRI PAB UCITS ETF.

© DWS Investments UK Limited 2024.