

25.09.2024

Veröffentlichung gemäß SFDR – Zusammenfassung

Xtrackers II Target Maturity Sept 2030 EUR Corporate Bond UCITS ETF

Dieses Finanzprodukt bewirbt 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 – Einzelheiten*“, das auf der Webseite des Finanzprodukts unter www.Xtrackers.com verfügbar ist.

Kein nachhaltiges Investitionsziel

Dieses Finanzprodukt bewirbt ökologische oder soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltige Investition zum Ziel.

Das Finanzprodukt verpflichtet sich, teilweise in nachhaltige Investitionen 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 Investitionen 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) SFDR unterliegt, indem es den 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.

referenzindex (wie nachstehend definiert) 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. Wertpapiere von Emittenten, die bestimmte Umwelt-, soziale und Unternehmensführungskriterien (ESG) nicht erfüllen, werden ausgeschlossen: (i) Unternehmensemittenten mit CCC-Rating von MSCI ESG Research, (ii) Unternehmensemittenten mit einem MSCI ESG Controversies Score „Red“ (unter 1), (iii) Unternehmensemittenten, bei denen MSCI im Rahmen des MSCI ESG Business Involvement Screening Research („BISR“) Verstöße gegen bestimmte Schwellenwerte bei umstrittenen Aktivitäten oder Geschäftsfeldern festgestellt hat, (iv) staatliche Emittenten, die ein Rating von B oder niedriger erhalten haben, (v) staatliche Emittenten, die auf der Grundlage von Freedom-House-Daten als „nicht frei“ oder „teilweise frei“ eingestuft sind.

Anlagestrategie

Das Investitionsziel des Finanzprodukts besteht darin, die Wertentwicklung des „Referenzindex“, des Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2030 SRI Index, vor Gebühren und Aufwendungen abzubilden, der darauf ausgelegt ist, die Wertentwicklung des Marktes für auf Euro lautende, festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating mit Fälligkeitsterminen am oder zwischen dem 1. Oktober 2023 und dem 30. September 2030 abzubilden, wobei Anleihen ausgeschlossen sind, die bestimmte ESG-Kriterien (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) nicht erfüllen. Der Referenzindex berücksichtigt die oben genannten und im Prospekt näher beschriebenen ESG-Merkmale.

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen für ein Finanzprodukt, das Artikel 8(1) SFDR unterliegt, indem es den 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.

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.

Verhältnis der Investitionen

Dieses Finanzprodukt investiert mindestens 90 % seines Nettovermögens in Investitionen, die auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet sind. Innerhalb dieser Kategorie sind mindestens 1 % der Vermögenswerte des Finanzprodukts als nachhaltige Investitionen gemäß Artikel 2(17) 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-Kennzahlen 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 beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird anhand der folgenden Nachhaltigkeitskennzahlen gemessen:

- Engagement in sehr schwerwiegenden Kontroversen
- Engagement in Worst-in-Class-Emittenten
- Staatlicher ESG-Score
- Beteiligung an umstrittenen Waffen
- Engagement in fossilen Brennstoffen

Weitere Einzelheiten zu diesen Nachhaltigkeitsindikatoren sind dem Prospekt zu entnehmen.

Datenquellen und Datenverarbeitung

Der Referenzindex verwendet Daten von verschiedenen Produkten, die von MSCI ESG Research LLC bereitgestellt werden. Diese Produkte umfassen die Ergebnisse von MSCI Produktbezogene Offenlegungen für die Website 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.

ESG Ratings, MSCI ESG Business Involvement Screening Research („BISR“), MSCI ESG Controversies Scores und Freedom House.

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.

Mitwirkungspolitik

Die aktive Mitwirkung bei den Emittenten, in die wir investieren, wobei wir die Ausübung von Stimmrechten und einen aktiven Dialog nutzen, um einen positiven Wandel zugunsten der Kunden zu bewirken, ist ein wichtiger Bestandteil des Ansatzes der DWS-Gruppe für nachhaltiges Investment. DWS wendet eine Mitwirkungspolitik und eine Corporate Governance- und Stimmrechtsausübungsrichtlinie an.

Festgelegter Referenzwert

Der Referenzwert des Finanzprodukts ist der Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2030 SRI Index. Weitere Informationen zum Referenzindex können auf <https://www.bloombergindeces.com> abgerufen werden.

Wichtige Informationen

„Bloomberg®“ und der Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2030 Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und seinen verbundenen Unternehmen, einschließlich Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index (zusammen „Bloomberg“), und wurden von Xtrackers II zur Nutzung für bestimmte Zwecke lizenziert. Bloomberg ist nicht mit Xtrackers II verbunden, und Bloomberg genehmigt, unterstützt, prüft oder empfiehlt den Xtrackers II Target Maturity Sept 2030 EUR Corporate Bond UCITS ETF nicht. Bloomberg übernimmt keine Garantie für die Aktualität, Richtigkeit oder Vollständigkeit irgendwelcher Daten oder Informationen in Bezug auf den Xtrackers II Target Maturity Sept 2030 EUR Corporate Bond UCITS ETF.

© DWS Investments UK Limited 2024.