

26.09.2023

# Veröffentlichung gemäß SFDR – Zusammenfassung

Xtrackers EuropeBiodiversity Focus SRI 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 - Einzelheiten“, 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 (wie nachstehend definiert) abbildet, der ökologische und/oder soziale Erwägungen einbezieht. Das Finanzprodukt hält ein Portfolio von Aktienwerten, das alle oder einen erheblichen Teil der im Referenzindex enthaltenen Wertpapiere umfasst. Wertpapiere aus dem Ausgangs-Index, die unter Verwendung von ESG-Daten von Institutional Shareholder Services Inc. (ISS ESG) bestimmte ESG- oder Biodiversitätskriterien nicht erfüllen, werden ausgeschlossen, was unter anderem die folgenden Wertpapiere betrifft: (i) Wertpapiere ohne Bewertung durch ISS ESGG; (ii) Wertpapiere, die mit einem ESG-Rating von D+ oder niedriger bewertet werden; (iii) Wertpapiere, die von ISS ESG im Rahmen des normenbasierten Screenings als „Rot“ eingestuft wurden; (iv) Wertpapiere, die in „schwerwiegende“ oder „sehr schwerwiegende“ Kontroversen in Bezug auf den Umweltschutz verwickelt sind; (v) Wertpapiere, die

als an umstrittenen Waffen beteiligt eingestuft wurden; (vi) Wertpapiere, die gegen bestimmte Umsatzschwellen in Bezug auf umstrittene Aktivitäten verstoßen; und/oder (vii) Wertpapiere, die gegen bestimmte Umsatzschwellen in Bezug auf bestimmte Aktivitäten mit dem Potenzial, die Biodiversität zu beeinträchtigen, verstoßen. Bei der Bewertung der Auswirkungen auf die Biodiversität wird das Biodiversity Impact Assessment Tool von ISS ESG im Hinblick auf den Anteil potenziell verschwundener Arten (Potentially Disappeared Fraction, „PDF“) verwendet, womit die Auswirkungen von Unternehmen auf die Biodiversität quantifiziert werden sollen, indem der potenzielle Rückgang der Artenvielfalt in einem Gebiet über einen bestimmten Zeitraum gemessen wird. Wertpapiere aus dem Ausgangs-Index werden nach dem Verhältnis von PDF zum Unternehmenswert einschließlich Barmittel eingestuft, und die schlechtesten 20 % der Unternehmen innerhalb eines jedes Sektors werden aus dem Index ausgeschlossen, ebenso wie Wertpapiere, für die keine Daten verfügbar sind. Es wird eine Bewertung der Auswirkungen hinsichtlich der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) durchgeführt. Hierfür berechnet ISS ESG einen aggregierten SDG Impact Rating Score auf der Grundlage bestimmter SDGs mit Bezug zu Biodiversität und die schlechtesten 20 % der Unternehmen innerhalb jedes Sektors im Ausgangs-Index werden aus dem Index ausgeschlossen. Der Index enthält auch eine Regel zur Verringerung der Kohlenstoffemissionen, die vorsieht, dass, wenn die Treibhausgasintensität des Index im Vergleich zum Ausgangs-Index nach Anwendung der oben genannten Ausschluss- und Bewertungskriterien unzureichend reduziert wurde, die Bestandteile in absteigender Reihenfolge der Treibhausgasintensität ausgeschlossen werden, bis eine entsprechende Reduzierungsschwelle erreicht wird.

## Anlagestrategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, die Wertentwicklung des „Referenzindex“ (ISS STOXX® Europe 600 Biodiversity Focus SRI Index) vor Gebühren und Aufwendungen abzubilden. Der Referenzindex soll die Wertentwicklung von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Europa abbilden, die bestimmte Mindeststandards in Bezug auf Biodiversität und auf die Bereiche Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) bezogene Kriterien erfüllen. Der Referenzindex basiert auf dem STOXX® Europe 600 Index (der „Ausgangs-Index“). Der Ausgangs-Index umfasst Unternehmen in Europa. Bestandteile des Ausgangs-Index, die bestimmte Mindeststandards in

Bezug auf Biodiversität und auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) bezogene Kriterien erfüllen, können in den Referenzindex aufgenommen werden.

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 aus sowie Unternehmen, die anhand von ESG-Daten von ISS gegen bestimmte internationale Normenstandards verstoßen (einschließlich Kontroversen in Bezug auf die Unternehmensführung). Darüber hinaus werden Unternehmen ausgeschlossen, deren ISS 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 ESG-Daten fehlen.

### Anteil der Investitionen

Dieses Finanzprodukt investiert mindestens 90 % seines Nettovermögens in Investitionen, die auf die geförderten ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet sind. Innerhalb dieser Kategorie sind mindestens 10 % 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:

- Engagement in sehr schwerwiegenden Kontroversen
- Engagement in Worst-in-Class-Emittenten
- Beteiligung an umstrittenen Waffen
- Engagement in fossilen Brennstoffen
- Beteiligung an biodiversitätsbezogenen Kontroversen
- SDG Impact Rating
- Treibhausgasintensität

Weitere Einzelheiten zu diesen Nachhaltigkeitsindikatoren sind dem Prospekt zu entnehmen.

### Datenquellen und Datenverarbeitung

Der Referenzindex verwendet Daten von verschiedenen Produkten, die von ISS ESG bereitgestellt werden. Zu diesen Produkten gehören

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.

das ISS ESG Unternehmens-Rating, das normenbasierte Screening von ISS ESG, das ISS ESG Biodiversity Impact Assessment Tool, das SDG Impact Rating von ISS ESG und ISS ESG Climate Solutions.

### 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

Das aktive Engagement 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 Engagement-Richtlinie und eine Corporate Governance- und Stimmrechtsausübungsrichtlinie an.

### Festgelegter Referenzwert

Für das Finanzprodukt wurde der ISS STOXX® Europe 600 Biodiversity Focus SRI Index als Referenzwert bestimmt.

Weitere Informationen zum Referenzindex können auf [www.stoxx.com](http://www.stoxx.com) abgerufen werden.

### Wichtige Informationen

Der ISS STOXX® Europe 600 Biodiversity Focus SRI Index (der „Index“) ist das geistige Eigentum (einschließlich eingetragener Marken) der STOXX Ltd., der Qontigo Index GmbH oder von deren Lizenzgebern und wird im Rahmen einer Lizenz genutzt. Der Xtrackers Europe Biodiversity Focus SRI UCITS ETF wird von der STOXX Ltd., der Qontigo Index GmbH oder deren Lizenzgebern, Researchpartnern oder Datenanbietern weder gesponsert noch beworben, vertrieben oder auf sonstige Weise unterstützt, und die STOXX Ltd., die Qontigo Index GmbH und ihre Lizenzgeber, Researchpartner und Datenanbieter übernehmen keine Gewährleistung und schließen diesbezüglich allgemein oder speziell jegliche Haftung (aufgrund von Fahrlässigkeit oder aus sonstigen Gründen) für Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen des Index oder seiner Daten aus.

© DWS Investments UK Limited 2023.