

01.01.23

Veröffentlichung gemäß SFDR - Zusammenfassung

Xtrackers II Eurozone Government Green Bond UCITS ETF

Dieses Finanzprodukt hat nachhaltige Investitionen zum Ziel und erfüllt die Voraussetzungen für ein Produkt gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

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 verfügbar ist.

Keine erhebliche Beeinträchtigung des nachhaltigen Anlageziels

Dieses Finanzprodukt verfolgt ein nachhaltiges Investitionsziel. 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 der Verstoß gegen internationale Normen 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.

Nachhaltiges Anlageziel des Finanzprodukts

Das Finanzprodukt verfolgt ein nachhaltiges Investitionsziel und erfüllt durch Nachbildung des Referenzindex (wie nachstehend definiert) die Voraussetzungen eines Finanzprodukts gemäß Artikel 9(1) SFDR. Der Referenzindex soll die Wertentwicklung von auf EUR lautenden grünen Staatsanleihen abbilden. Die Referenzindexregeln zielen darauf ab, eine breite Abdeckung des Universums grüner Staatsanleihen zu bieten, die bestimmte Mindestkriterien in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) erfüllen. 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 bestimmt seine Bestandteile anhand der folgenden ESG-Auswahlkriterien: (i) Freedom House Global Freedom Status, (ii) Länderrisikokategorie von Sustainalytics und (iii) Green Bond Classification.

Anlagestrategie

Das Investitionsziel des Finanzprodukts besteht darin, die Wertentwicklung vor Gebühren und Aufwendungen des „Referenzindex“ iBoxx EUR Eurozone Sovereigns Green Bonds Capped Index abzubilden. Der Referenzindex bildet die Wertentwicklung von auf EUR lautenden grünen Staatsanleihen ab. Die Referenzindexregeln zielen darauf ab, eine breite Abdeckung des Universums der grünen Staatsanleihen zu bieten, die bestimmte Mindestkriterien in Bezug auf ESG erfüllen, und gleichzeitig Mindeststandards für die Investierbarkeit und Liquidität einzuhalten.

Da das Finanzprodukt ausschließlich in Staatsanleihen investiert, gibt es keine Politik zur Bewertung der Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung von Unternehmen, in die investiert würde. Das Anlageziel des Finanzprodukts besteht jedoch darin, die Wertentwicklung vor Gebühren und Kosten des Referenzindex nachzubilden, der Länder ausschließt, die auf der Grundlage von Freedom House-Klassifizierungen (u. a. Bewertung der politischen Freiheit und der Menschenrechte) nicht frei sind, sowie Länder, deren ESG-Score (der u. a. die Governance-Risiken eines Landes bewertet) unter einem bestimmten Schwellenwert liegt.

Allokation der Anlagen

Dieses Finanzprodukt investiert mindestens 90 % seines Nettovermögens in Anlagen, die auf nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen oder sozialen Ziel im Sinne von Artikel 2(17) SFDR ausgerichtet sind. Bis zu 10 % der Investitionen sind nicht auf diese 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 des nachhaltigen Anlageziels

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 des nachhaltigen Anlageziels des Finanzprodukts wird anhand der folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen:

- Exposure in grünen Anleihen
- Staatlicher ESG-Score

Weitere Einzelheiten zu diesen Nachhaltigkeitsindikatoren sind dem Prospekt zu entnehmen.

Datenquellen und Datenverarbeitung

Der Referenzindex nutzt ESG-Daten von Sustainalytics by Morningstar („Sustainalytics“) 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.

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

Der iBoxx EUR Eurozone Sovereigns Green Bonds Capped Index wurde als Referenzwert für das Finanzprodukt festgelegt.

Weitere Informationen zum Referenzindex können auf www.ihsmarket.com abgerufen werden.

Wichtige Informationen

Der Index und die darin enthaltenen Marken sind geistiges Eigentum von Markit Indices Limited und/oder ihrer Lizenzgeber („Markit“) und werden im Rahmen einer Lizenz von Markit genutzt. Der Fonds wird nicht von Markit gesponsert, unterstützt, verkauft oder beworben. Markit übernimmt diesbezüglich keine Haftung und gibt keine ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien oder Zusicherungen in Bezug auf die Richtigkeit, die Eignung für einen bestimmten Zweck oder die durch die Nutzung des Index erzielten Ergebnisse. Der vollständige Haftungsausschluss ist im Fondsprospekt zu finden.

© DWS Investments UK Limited 2023.