

10. Februar 2025

Veröffentlichung gemäß SFDR - Zusammenfassung

Xtrackers S&P 500 Equal Weight Scored & Screened UCITS ETF

Dieses Finanzprodukt fördert ökologische und soziale Eigenschaften und gilt als Produkt im Sinne von 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 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 qualifiziert als Produkt gemäß Artikel 8 Absatz 1 SFDR durch Nachbildung des Referenzindex (wie unten definiert), der ökologische und/oder soziale Kriterien berücksichtigt. Das Finanzprodukt hält ein Wertpapierportfolio, das alle oder eine erhebliche Anzahl der Bestandteile des Referenzindex umfasst. Bei der Zusammensetzung des Referenzindex werden Unternehmen aus dem Ausgangsindex (wie unten definiert) ausgeschlossen, die bestimmte ESG-Kriterien nicht erfüllen, insbesondere Unternehmen, (i) die mit ihrem S&P Global ESG Score zu den 25% der Unternehmen mit dem schlechtesten ESG-Score aus jeder GICS-Bereichsgruppe zählen oder keinen ESG Score haben, (ii) gemäß der Einstufung durch S&P Global Business Involvement Screens bestimmte Obergrenzen für Umsätze aus kontroversen Tätigkeiten überschreiten und/oder (iii) nach Feststellung von Sustainalytics nicht nach den UNGC-Prinzipien und den damit verbundenen Standards, Übereinkommen und Abkommen handeln. Die restlichen Unternehmen werden dann in absteigender Reihenfolge ihres ESG-Score mit einer Methodik ausgewählt, um den angestrebten 60% der im Ausgangsindex enthaltenen Anzahl von Unternehmen möglichst nahe zu kommen.

Anlagestrategie

Das Anlageziel des Finanzprodukts besteht darin, die Wertentwicklung des S&P 500 Equal Weight Scored & Screened Index (der „Referenzindex“) vor Gebühren und Aufwendungen abzubilden. Der Referenzindex repliziert die Entwicklung der Aktien von Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung aus allen wichtigen Industriezweigen in den USA, die bestimmte ökologische, soziale und die Unternehmensführung betreffende Kriterien (sog. ESG-Kriterien) erfüllen. Der Referenzindex basiert auf dem S&P 500 Equal Weight Index (der „Ausgangsindex“), einem gleichgewichteten Index, der die Wertentwicklung der Aktien großer börsennotierter US-amerikanischer Unternehmen, die aktiv an geregelten Handelsplätzen gehandelt werden, widerspiegelt.

Der Referenzindex bezieht die oben dargelegten ESG-Merkmale ein, die im Verkaufsprospekt ausführlicher beschrieben werden. Zur Berücksichtigung der Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung von Beteiligungsunternehmen schließt der Referenzindex auf Grundlage der ESG-Daten von Sustainalytics Unternehmen aus, die gegen bestimmte internationale Normen verstoßen (wozu auch Kontroversen in Bezug auf Unternehmensführung gehören). Ebenfalls ausgeschlossen werden Unternehmen mit einem S&P Global ESG Score (mit dem unter anderem bewertet wird, wie gut Unternehmen Governance-Risiken und -Chancen steuern) unter einem bestimmten Schwellenwert oder ohne ESG-Daten.

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 kontroversen Waffen
- Beteiligung an Tabak

Weitere Einzelheiten zu diesen Nachhaltigkeitsindikatoren sind dem Prospekt zu entnehmen.

Datenquellen und Datenverarbeitung

Der Referenzindex nutzt ESG-Daten von Sustainable1, ein Geschäftsbereich von S&P Global, Sustainalytics by Morningstar, und RepRisk.

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

Das Finanzprodukt hat den S&P 500 Equal Weight Scored & Screened Index als Referenzwert festgelegt. Weitere Informationen zum Referenzindex sind verfügbar unter <https://www.spglobal.com/en/>.

Wichtige Informationen

Der Index ist eine Handelsmarke von Standard & Poor's und wurde zur Nutzung durch den Fonds lizenziert. Der Fonds wird nicht durch Standard & Poor's gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben, und Standard & Poor's gibt keine Anlageempfehlung zu diesem Fonds ab.

© DWS Investments UK Limited 2025.