

Xtrackers II

Société d'Investissement à capital variable
R.C.S. Luxembourg N° B-124.284

Rapport semestriel non audité
pour la période du 1^{er} janvier 2020 au 30 juin 2020

Aucune souscription ne peut être reçue sur la base des États Financiers. Les souscriptions ne sont valables que si elles ont été effectuées sur la base du dernier Prospectus de Xtrackers II publié, accompagné du dernier rapport annuel et du dernier rapport semestriel, si celui-ci est plus récent que le rapport annuel.

Sommaire

	<u>Page</u>
Organisation	3
Statistiques	5
État de l'Actif net au 30 juin 2020	15
État des portefeuilles au 30 juin 2020	25
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	25
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	36
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	38
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	39
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	40
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	42
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	44
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	45
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	51
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	53
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	56
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	58
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	61
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	62
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	74
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	76
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	78
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	81
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	83
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	110
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	111
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	117
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	120
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	198
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	200
Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	201
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	256
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	258
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	263
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	264
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	266
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	268
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	270
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	281
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	290
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	306
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	311
Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF	312
Notes aux États Financiers	316
Informations destinées aux Actionnaires	344

Xtrackers II

Organisation

Siège social Xtrackers II 49, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg
Conseil d'administration <ul style="list-style-type: none">- Thilo Wendenburg⁽¹⁾ Administrateur indépendant, DWS Investment S.A., 2, boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg.- Manooj Mistry⁽²⁾ Directeur mondial DWS de la division Index Investing, DWS Investments UK Limited, Winchester House, 1 Great Winchester St, Londres EC2N 2DB, Royaume-Uni.- Philippe Ah-Sun Directeur des Opérations - Index Investing, DWS Investments UK Limited, Winchester House, 1 Great Winchester Street, Londres EC2N 2DB, Royaume-Uni.- Alex McKenna Responsable de la conception des plates-formes de produits au sein de DWS Investments UK Limited, Winchester House, 1 Great Winchester St, Londres EC2N 2DB, Royaume-Uni.- Freddy Brausch Membre du Barreau de Luxembourg, administrateur indépendant, 35, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg.
Dépositaire State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg 49, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg
Société de Gestion DWS Investment S.A. 2, boulevard Konrad Adenauer L-1115 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg
Agent Administratif, Agent Payeur, Agent Domiciliaire et Agent de Cotation State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg 49, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg
Agent de Registre et de Transfert State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg 49, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg

⁽¹⁾Thilo Wendenburg a été nommé membre du Conseil d'administration lors de l'Assemblée générale en date du 26 juin 2020.

⁽²⁾Manooj Mistry a soumis une lettre de démission au Conseil d'administration à la date du 30 juin 2020. En conséquence, Manooj Mistry n'est plus membre du Conseil d'administration depuis la date susmentionnée.

Xtrackers II

Organisation (suite)

Gestionnaires d'Investissement / Gestionnaires de Portefeuille Délégués de certains Compartiments (voir Note 12)

DWS Investments UK Limited
Winchester House
1 Great Winchester Street
Londres EC2N 2DB
Royaume-Uni

DWS Investment GmbH
Mainzer Landstrasse 11-17
60329 Francfort-sur-le-Main
Allemagne

DWS Investments Hong Kong Limited
Level 52/F, International Commerce Centre
1 Austin Road West,
Kowloon, Hong Kong⁽¹⁾

Harvest Global Investments Limited
31/F One Exchange Square
8 Connaught Place, Central
Hong Kong

Agent de Prêt de Titres de certains Compartiments (voir Note 8)

Deutsche Bank AG, siège de Francfort
Taubusanlage 12
60325 Francfort-sur-le-Main
Allemagne

Deutsche Bank AG, succursale de Londres
Winchester House
1 Great Winchester Street
Londres EC2N 2DB
Royaume-Uni

Deutsche Bank AG, succursale de New York
60 Wall Street
New York NY 10005
États-Unis d'Amérique

Contrôleur de Comptes de la Société

Ernst & Young S.A.
35E, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Conseillers juridiques de la Société

Elvinger Hoss Prussen
société anonyme
2, place Winston Churchill
L-1340 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Les termes qui commencent par une majuscule dans ce document ont la même signification que dans le prospectus de Xtrackers II applicable au 30 juin 2020 (le « Prospectus ») sauf indication contraire du contexte.

⁽¹⁾A partir du 12 février 2020.

Xtrackers II

Statistiques

	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF EUR
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	3 161 858 626	429 736 961	239 121 259	341 325 108
1D	448 989 755	18 897 236	19 332 935	–
2C - USD Hedged	3 116 159 ^{(1),(2)}	–	–	–
31 décembre 2019				
1C	2 714 147 518	463 634 156	264 669 043	379 134 488
1D	324 771 964	19 442 646	23 949 341	–
2C - USD Hedged	–	–	–	–
31 décembre 2018				
1C	2 467 381 772	407 740 724	263 234 803	296 709 097
1D	124 369 302	32 125 922	51 866 314	–
2C - USD Hedged	–	–	–	–
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	251,05	168,40	208,22	247,29
1D	215,75	159,35	196,61	–
2C - USD Hedged	72,47 ^{(1),(2)}	–	–	–
31 décembre 2019				
1C	246,21	168,78	207,37	244,72
1D	212,17	159,71	196,58	–
2C - USD Hedged	–	–	–	–
31 décembre 2018				
1C	231,05	168,52	202,10	234,87
1D	199,76	159,46	191,58	–
2C - USD Hedged	–	–	–	–

⁽¹⁾Catégorie d'Actions lancée le 11 mars 2020. Veuillez vous reporter au point 1 de la section des autres événements significatifs sur la période des notes aux États Financiers du présent rapport semestriel pour de plus amples informations.

⁽²⁾Catégorie d'Actions exprimée en USD.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF EUR	Xtrackers II GLOBAL INFLATION- LINKED BOND UCITS ETF EUR
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	92 432 805	31 309 363	34 337 385	–
1C - EUR Hedged	–	–	–	780 181 900
1D - EUR Hedged	–	–	–	168 336 715
2C - USD Hedged	–	–	–	51 359 518 ⁽²⁾
3D - GBP Hedged	–	–	–	178 145 881 ⁽³⁾
4D - CHF Hedged	–	–	–	74 815 228 ⁽⁴⁾
5C	–	–	–	163 903 698
31 décembre 2019				
1C	70 599 162	37 897 495	29 032 952	–
1C - EUR Hedged	–	–	–	659 998 715
1D - EUR Hedged	–	–	–	148 345 301
2C - USD Hedged	–	–	–	46 278 180 ⁽²⁾
3D - GBP Hedged	–	–	–	128 613 959 ⁽³⁾
4D - CHF Hedged	–	–	–	65 493 527 ⁽⁴⁾
5C	–	–	–	126 988 605
31 décembre 2018				
1C	84 966 530	23 502 619	24 036 185	–
1C - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	502 494 126
1D - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	158 176 956
2C - USD Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	46 837 090 ⁽²⁾
3D - GBP Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	95 939 316 ⁽³⁾
4D - CHF Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	61 700 410 ⁽⁴⁾
5C	–	–	–	194 504 989
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	284,16	400,97	447,41	–
1C - EUR Hedged	–	–	–	246,68
1D - EUR Hedged	–	–	–	224,86
2C - USD Hedged	–	–	–	28,31 ⁽²⁾
3D - GBP Hedged	–	–	–	27,28 ⁽³⁾
4D - CHF Hedged	–	–	–	113,02 ⁽⁴⁾
5C	–	–	–	23,88
31 décembre 2019				
1C	278,74	382,48	416,26	–
1C - EUR Hedged	–	–	–	233,66
1D - EUR Hedged	–	–	–	216,16
2C - USD Hedged	–	–	–	26,61 ⁽²⁾
3D - GBP Hedged	–	–	–	26,01 ⁽³⁾
4D - CHF Hedged	–	–	–	108,86 ⁽⁴⁾
5C	–	–	–	23,01
31 décembre 2018				
1C	261,21	330,63	344,62	–
1C - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	222,26
1D - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	207,52
2C - USD Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	24,60 ⁽²⁾
3D - GBP Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	24,59 ⁽³⁾
4D - CHF Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	104,90 ⁽⁴⁾
5C	–	–	–	20,92

⁽²⁾Catégorie d'Actions exprimée en USD.

⁽³⁾Catégorie d'Actions exprimée en GBP.

⁽⁴⁾Catégorie d'Actions exprimée en CHF.

⁽⁵⁾Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2018, cette Catégorie d'Actions a changé de nom.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II EUROZONE INFLATION- LINKED BOND UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF EUR	Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF EUR	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF EUR
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	399 402 336	537 624 175	14 257 088	113 498 579
1D	–	10 502 477	–	–
31 décembre 2019				
1C	341 488 512	383 534 850	23 637 411	142 822 141
1D	–	5 564 125	–	–
31 décembre 2018				
1C	391 703 164	655 434 550	26 998 673	163 308 041
1D	–	15 958 620	–	–
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	223,77	136,34	120,10	188,61
1D	–	127,61	–	–
31 décembre 2019				
1C	227,67	136,72	121,08	200,23
1D	–	127,97	–	–
31 décembre 2018				
1C	214,06	137,40	117,91	188,28
1D	–	128,61	–	–

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF
	EUR	USD	EUR	EUR
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	45 410 957	–	42 768 673	78 304 751
1C - EUR Hedged	–	513 635 899 ⁽⁶⁾	–	–
1D	–	–	–	3 294 756
2C	–	19 053 170 ⁽¹⁾	–	–
2D	–	996 279 595	–	–
31 décembre 2019				
1C	100 032 257	–	39 855 057	81 403 210
1C - EUR Hedged	–	490 426 893 ⁽⁶⁾	–	–
1D	–	–	–	3 258 095
2C	–	–	–	–
2D	–	1 229 594 578	–	–
31 décembre 2018				
1C	64 337 321	–	68 244 716	85 013 263
1C - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	505 445 047 ⁽⁶⁾	–	–
1D	–	–	–	1 155 570
2C	–	–	–	–
2D	–	427 189 901	–	–
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	40,38	–	67,87	202,39
1C - EUR Hedged	–	315,91 ⁽⁶⁾	–	–
1D	–	–	–	193,05
2C	–	38,06 ⁽¹⁾	–	–
2D	–	14,41	–	–
31 décembre 2019				
1C	39,23	–	69,90	200,14
1C - EUR Hedged	–	336,08 ⁽⁶⁾	–	–
1D	–	–	–	190,90
2C	–	–	–	–
2D	–	15,88	–	–
31 décembre 2018				
1C	43,21	–	75,73	195,73
1C - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	301,60 ⁽⁶⁾	–	–
1D	–	–	–	187,38
2C	–	–	–	–
2D	–	13,90	–	–

⁽¹⁾Catégorie d'Actions lancée le 11 mars 2020. Veuillez vous reporter au point 1 de la section des autres événements significatifs sur la période des notes aux États Financiers du présent rapport semestriel pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2018, cette Catégorie d'Actions a changé de nom.

⁽⁶⁾Catégorie d'Actions exprimée en EUR.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF USD	Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF GBP	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF EUR	Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF SGD
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	227 491 573	–	–	136 641 258
1C - EUR Hedged	–	–	1 232 093 013	–
1D	–	102 093 432	–	–
1D - EUR Hedged	–	–	254 142 563	–
2D - GBP Hedged	–	–	129 123 880 ⁽³⁾	–
3C - USD Hedged	–	–	34 073 646 ⁽²⁾	–
4C - CHF Hedged	–	–	112 204 843 ⁽⁴⁾	–
5C	–	–	796 639 098	–
31 décembre 2019				
1C	162 275 601	–	–	132 431 034
1C - EUR Hedged	–	–	681 241 972	–
1D	–	99 561 933	–	–
1D - EUR Hedged	–	–	238 381 795	–
2D - GBP Hedged	–	–	131 580 173 ⁽³⁾	–
3C - USD Hedged	–	–	57 280 356 ⁽²⁾	–
4C - CHF Hedged	–	–	66 842 868 ⁽⁴⁾	–
5C	–	–	853 616 230	–
31 décembre 2018				
1C	329 356 755	–	–	143 525 612
1C - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	–	453 553 476	–
1D	–	103 732 822	–	–
1D - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	–	217 841 943	–
2D - GBP Hedged ⁽⁵⁾	–	–	160 157 138 ⁽³⁾	–
3C - USD Hedged ⁽⁵⁾	–	–	12 287 427 ⁽²⁾	–
4C - CHF Hedged ⁽⁵⁾	–	–	46 296 925 ⁽⁴⁾	–
5C	–	–	599 690 786	–
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	179,44	–	–	158,98
1C - EUR Hedged	–	–	244,02	–
1D	–	181,50	–	–
1D - EUR Hedged	–	–	226,06	–
2D - GBP Hedged	–	–	29,01 ⁽³⁾	–
3C - USD Hedged	–	–	14,05 ⁽²⁾	–
4C - CHF Hedged	–	–	187,38 ⁽⁴⁾	–
5C	–	–	262,74	–
31 décembre 2019				
1C	178,98	–	–	149,05
1C - EUR Hedged	–	–	234,27	–
1D	–	182,36	–	–
1D - EUR Hedged	–	–	219,23	–
2D - GBP Hedged	–	–	28,00 ⁽³⁾	–
3C - USD Hedged	–	–	13,37 ⁽²⁾	–
4C - CHF Hedged	–	–	180,26 ⁽⁴⁾	–
5C	–	–	252,07	–
31 décembre 2018				
1C	175,36	–	–	142,88
1C - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	–	224,69	–
1D	–	183,10	–	–
1D - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	–	212,18	–
2D - GBP Hedged ⁽⁵⁾	–	–	26,70 ⁽³⁾	–
3C - USD Hedged ⁽⁵⁾	–	–	12,46 ⁽²⁾	–
4C - CHF Hedged ⁽⁵⁾	–	–	173,80 ⁽⁴⁾	–
5C	–	–	234,54	–

⁽²⁾Catégorie d'Actions exprimée en USD.

⁽³⁾Catégorie d'Actions exprimée en GBP.

⁽⁴⁾Catégorie d'Actions exprimée en CHF.

⁽⁵⁾Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2018, cette Catégorie d'Actions a changé de nom.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF USD	Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF USD	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF EUR	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF EUR
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	–	–	2 240 107 057	214 242 211
1D	533 976 302	88 017 795	–	56 923 170
2D - EUR Hedged	650 963 608 ⁽⁶⁾	–	–	–
31 décembre 2019				
1C	–	–	1 565 592 724	177 090 376
1D	599 020 318	115 472 636	–	60 693 056
2D - EUR Hedged	401 113 192 ⁽⁶⁾	–	–	–
31 décembre 2018				
1C	–	–	716 617 540	102 846 415
1D	416 482 419	134 191 037	–	99 121 181
2D - EUR Hedged ⁽⁵⁾	313 730 697 ⁽⁶⁾	–	–	–
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	–	–	157,26	209,12
1D	241,80	172,85	–	213,58
2D - EUR Hedged	124,93 ⁽⁶⁾	–	–	–
31 décembre 2019				
1C	–	–	159,49	204,63
1D	224,01	172,03	–	209,00
2D - EUR Hedged	117,63 ⁽⁶⁾	–	–	–
31 décembre 2018				
1C	–	–	150,31	198,94
1D	212,94	168,32	–	203,19
2D - EUR Hedged ⁽⁵⁾	114,91 ⁽⁶⁾	–	–	–

⁽⁵⁾Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2018, cette Catégorie d'Actions a changé de nom.

⁽⁶⁾Catégorie d'Actions exprimée en EUR.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF EUR	Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF EUR	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF EUR
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	–	–	85 288 331	684 400 696
1D	9 358 423	589 975 891	6 332 631	166 399 044
2C - Duration Hedged	–	–	–	–
31 décembre 2019				
1C	–	–	80 291 609	965 833 645
1D	9 389 311	405 915 525	6 195 370	162 823 556
2C - Duration Hedged	–	–	–	–
31 décembre 2018				
1C	–	–	66 399 856	938 692 791
1D	13 864 416	83 110 832	12 873 616	175 070 893
2C - Duration Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	–
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	–	–	238,00	189,11
1D	144,63	154,92	229,09	174,78
2C - Duration Hedged	–	–	–	–
31 décembre 2019				
1C	–	–	232,83	186,65
1D	145,10	157,51	224,13	174,60
2C - Duration Hedged	–	–	–	–
31 décembre 2018				
1C	–	–	226,09	170,60
1D	146,39	149,78	218,43	160,71
2C - Duration Hedged ⁽⁵⁾	–	–	–	108,75 ⁽⁷⁾

⁽⁵⁾Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2018, cette Catégorie d'Actions a changé de nom.

⁽⁷⁾Cette Catégorie d'Actions a fait l'objet d'un rachat obligatoire par la Société le 19 juin 2018. La dernière Valeur Liquidative par Action avant le rachat est divulguée.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF AUD	Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF EUR	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF EUR
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	42 526 284	116 144 105	8 911 964	499 684 185
1D	–	–	–	8 924 272
31 décembre 2019				
1C	36 371 509	175 535 410	39 851 421	591 424 644
1D	–	–	–	8 968 089
31 décembre 2018				
1C	29 513 035	77 180 351	36 695 427	531 882 039
1D	–	–	–	23 499 013
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	261,99	31,46	166,40	143,57
1D	–	–	–	138,73
31 décembre 2019				
1C	252,02	31,49	163,16	143,61
1D	–	–	–	139,41
31 décembre 2018				
1C	233,64	31,49	155,88	141,89
1D	–	–	–	137,74

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF JPY	Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF USD	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF EUR
Valeur Liquidative totale				
30 juin 2020				
1C	141 582 897 886	–	64 057 938	–
1D	–	313 545 107	336 140 651	201 705 056
2C - USD Hedged	–	46 686 714	–	–
3D - GBP Hedged	–	7 038 655 ⁽³⁾	–	–
4C - CHF Hedged	–	85 476 261 ⁽⁴⁾	–	–
5C - EUR Hedged	–	375 847 464 ⁽⁶⁾	–	–
31 décembre 2019				
1C	69 217 938 726	–	18 342 913	–
1D	–	297 183 193	251 931 714	232 442 215
2C - USD Hedged	–	48 752 483	–	–
3D - GBP Hedged	–	4 928 706 ⁽³⁾	–	–
4C - CHF Hedged	–	101 897 203 ⁽⁴⁾	–	–
5C - EUR Hedged	–	346 627 313 ⁽⁶⁾	–	–
31 décembre 2018				
1C	53 646 501 704	–	1 972 769	–
1D	–	227 736 748	117 210 960	153 462 471
2C - USD Hedged ⁽⁵⁾	–	45 903 721	–	–
3D - GBP Hedged ⁽⁵⁾	–	4 078 540 ⁽³⁾	–	–
4C - CHF Hedged ⁽⁵⁾	–	101 570 427 ⁽⁴⁾	–	–
5C - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	265 602 480 ⁽⁶⁾	–	–
Valeur Liquidative par Action				
30 juin 2020				
1C	1 401,67	–	19,12	–
1D	–	47,99	16,18	9,19
2C - USD Hedged	–	57,91	–	–
3D - GBP Hedged	–	80,59 ⁽³⁾	–	–
4C - CHF Hedged	–	18,25 ⁽⁴⁾	–	–
5C - EUR Hedged	–	23,06 ⁽⁶⁾	–	–
31 décembre 2019				
1C	1 420,20	–	20,23	–
1D	–	47,30	17,54	9,97
2C - USD Hedged	–	55,80	–	–
3D - GBP Hedged	–	79,00 ⁽³⁾	–	–
4C - CHF Hedged	–	17,76 ⁽⁴⁾	–	–
5C - EUR Hedged	–	22,39 ⁽⁶⁾	–	–
31 décembre 2018				
1C	1 390,74	–	18,51	–
1D	–	45,16	16,64	9,60
2C - USD Hedged ⁽⁵⁾	–	51,66	–	–
3D - GBP Hedged ⁽⁵⁾	–	75,69 ⁽³⁾	–	–
4C - CHF Hedged ⁽⁵⁾	–	17,02 ⁽⁴⁾	–	–
5C - EUR Hedged ⁽⁵⁾	–	21,34 ⁽⁶⁾	–	–

⁽³⁾Catégorie d'Actions exprimée en GBP.

⁽⁴⁾Catégorie d'Actions exprimée en CHF.

⁽⁵⁾Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2018, cette Catégorie d'Actions a changé de nom.

⁽⁶⁾Catégorie d'Actions exprimée en EUR.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF
	USD	USD
<hr/>		
Valeur Liquidative totale		
30 juin 2020		
1D	65 761 133	21 434 753
31 décembre 2019		
1D	49 173 949	23 070 782
31 décembre 2018		
1D	37 792 000	16 639 249
Valeur Liquidative par Action		
30 juin 2020		
1D	21,24	122,01
31 décembre 2019		
1D	21,49	121,80
31 décembre 2018		
1D	21,60	114,72

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020

		Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF
	Note	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIFS					
Investissements à la valeur de marché		3 580 590 472	448 138 309	258 091 250	339 841 664
Liquidités en banque		2 908 688	87 362	0	423 704
Montant à recevoir du courtier		0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		0	0	0	0
Produits à recevoir pour Investissement vendu		0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	0	0	0
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets		30 594 829	465 838	365 170	1 101 108
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Plus-value latente sur Swap	4	0	0	0	0
Autres actifs		6 020	3 326	76 103	221
TOTAL DES ACTIFS		3 614 100 009	448 694 835	258 532 523	341 366 697
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	0	46 767	0
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les Investissements achetés		0	0	0	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		3 630	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	0	0	0
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	0	0	0
Moins-value latente sur Swap	4	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	38 326	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	132 249	19 855	10 499	13 708
Commissions Fixes	10	285 793	39 710	20 998	27 416
Autres engagements		17 149	1 073	65	465
TOTAL DES ENGAGEMENTS		477 147	60 638	78 329	41 589
TOTAL DES ACTIFS NETS		3 613 622 862	448 634 197	258 454 194	341 325 108

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

		Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	Xtrackers II GLOBAL INFLATION- LINKED BOND UCITS ETF
	Note	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIFS					
Investissements à la valeur de marché		92 047 648	30 948 860	34 082 625	1 408 925 006
Liquidités en banque		92 508	16 528	6 601	4 116 554
Montant à recevoir du courtier		0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		0	0	0	0
Produits à recevoir pour Investissement vendu		0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	0	0	0
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets		303 270	347 757	252 275	3 902 855
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	10 183 695
Plus-value latente sur Swap	4	0	0	0	0
Autres actifs		335	0	10	3 837
TOTAL DES ACTIFS		92 443 761	31 313 145	34 341 511	1 427 131 947
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	0	0	0
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les Investissements achetés		0	0	0	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		0	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	0	0	0
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	0	0	0
Moins-value latente sur Swap	4	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	3 557	1 261	1 375	167 317
Commissions Fixes	10	7 114	2 521	2 751	116 040
Autres engagements		285	0	0	2 417 048
TOTAL DES ENGAGEMENTS		10 956	3 782	4 126	2 700 405
TOTAL DES ACTIFS NETS		92 432 805	31 309 363	34 337 385	1 424 431 542

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

		Xtrackers II EUROZONE INFLATION- LINKED BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF
	Note	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIFS					
Investissements à la valeur de marché		396 948 063	541 031 584	14 170 677	110 403 191
Liquidités en banque		30 984	52 674	1 253	11 816
Montant à recevoir du courtier		0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		0	6 816 915	0	0
Produits à recevoir pour Investissement vendu		0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	8 587 433	0	1 329
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	0	20 605 514	21 163	8 976 936
Intérêts à recevoir, nets		2 486 119	1 473 543	3 924	166 045
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Plus-value latente sur Swap	4	0	0	62 393	0
Autres actifs		37	0	0	0
TOTAL DES ACTIFS		399 465 203	578 567 663	14 259 410	119 559 317
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	0	0	0
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les Investissements achetés		0	8 563 940	0	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		0	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	6 814 343	0	0
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	0	0	0
Moins-value latente sur Swap	4	0	14 975 321	0	6 036 925
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	31 345	10 564	1 032	13 891
Commissions Fixes	10	31 345	42 214	1 290	9 922
Autres engagements		177	34 629	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS		62 867	30 441 011	2 322	6 060 738
TOTAL DES ACTIFS NETS		399 402 336	548 126 652	14 257 088	113 498 579

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

	Note	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF EUR	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF USD	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF EUR	Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF EUR
ACTIFS					
Investissements à la valeur de marché		45 252 835	1 552 960 493	42 585 547	80 599 472
Liquidités en banque		30	11 081 455	0	0
Montant à recevoir du courtier		0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		0	0	0	0
Produits à recevoir pour Investissement vendu		0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		14 094	0	518	3 652
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	1 091 432	0	5 317 365	0
Intérêts à recevoir, nets		216 914	24 981 669	10 458	302 864
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	3 553 152	0	0
Plus-value latente sur Swap	4	0	0	0	8 598 943
Autres actifs		0	0	0	0
TOTAL DES ACTIFS		46 575 305	1 592 576 769	47 913 888	89 504 931
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	0	5 308	5 515
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les Investissements achetés		0	0	0	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		0	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	0	0	0
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	0	0	7 889 878
Moins-value latente sur Swap	4	1 147 874	0	5 134 602	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	9 610	232 724	1 768	3 344
Commissions Fixes	10	6 864	119 295	3 537	6 687
Autres engagements		0	1 808	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS		1 164 348	353 827	5 145 215	7 905 424
TOTAL DES ACTIFS NETS		45 410 957	1 592 222 942	42 768 673	81 599 507

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

		Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF
	Note	USD	GBP	EUR	SGD
ACTIFS					
Investissements à la valeur de marché		223 643 749	101 594 004	2 527 028 939	135 688 603
Liquidités en banque		5 742	5 140	5 628 373	9 498
Montant à recevoir du courtier		0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		0	0	0	0
Produits à recevoir pour Investissement vendu		0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		4 703	1 912	0	0
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	9 645 196	6 427 493	0	0
Intérêts à recevoir, nets		852 677	73 370	13 716 598	965 516
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	14 820 384	0
Plus-value latente sur Swap	4	0	0	0	0
Autres actifs		0	0	2 410	0
TOTAL DES ACTIFS		234 152 067	108 101 919	2 561 196 704	136 663 617
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	0	0	0
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les Investissements achetés		0	0	0	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		0	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	0	0	0
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	0	0	0
Moins-value latente sur Swap	4	6 633 102	5 996 057	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	9 131	4 144	282 895	11 179
Commissions Fixes	10	18 261	8 287	210 427	11 180
Autres engagements		0	0	7 463	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS		6 660 494	6 008 488	500 785	22 359
TOTAL DES ACTIFS NETS		227 491 573	102 093 431	2 560 695 919	136 641 258

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

		Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF
	Note	USD	USD	EUR
ACTIFS				
Investissements à la valeur de marché		1 246 805 285	87 521 851	2 227 300 148
Liquidités en banque		725 903	133 807	2 051 995
Montant à recevoir du courtier		0	0	529 447
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		7 314 783	0	16 982 708
Produits à recevoir pour Investissement vendu		0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	0	0
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets		6 122 154	367 454	15 062 885
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	11 406 711	0	0
Plus-value latente sur Swap	4	0	0	0
Autres actifs		6 249	0	1 152
TOTAL DES ACTIFS		1 272 381 085	88 023 112	2 261 928 335
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire		0	0	0
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées		0	0	3 139 359
Montant à payer pour les Investissements achetés		7 187 192	0	21 499 206
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		139	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	0	0
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	0	0
Moins-value latente sur Swap	4	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	108 450
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	9 221	760	35 618
Commissions Fixes	10	77 314	4 557	178 004
Autres engagements		1 120	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS		7 274 986	5 317	21 821 278
TOTAL DES ACTIFS NETS		1 265 106 099	88 017 795	2 240 107 057

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Xtrackers II ESG EUR EUROZONE CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF PLUS	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD UCITS ETF
Note	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIFS				
Investissements à la valeur de marché	9 296 171	586 725 681	91 406 391	842 052 380
Liquidités en banque	1 149	820 001	0	612 523
Montant à recevoir du courtier	0	59 116	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues	0	8 364 125	0	0
Produits à recevoir pour Investissement vendu	0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	0	0
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets	62 413	4 009 274	0	8 219 938
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Plus-value latente sur Swap	4	0	4 771 881	0
Autres actifs	0	0	0	0
TOTAL DES ACTIFS	9 359 733	599 978 197	96 178 272	850 884 841
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	0	0	4 031	0
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées	0	0	0	0
Montant à payer pour les Investissements achetés	0	9 915 492	0	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant	0	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap	0	0	0	0
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	4 542 083	0
Moins-value latente sur Swap	4	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	13 670	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	437	3 732	28 249
Commissions Fixes	10	873	7 464	56 505
Autres engagements	0	1 872	0	348
TOTAL DES ENGAGEMENTS	1 310	10 002 306	4 557 310	85 102
TOTAL DES ACTIFS NETS	9 358 423	589 975 891	91 620 962	850 799 739

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

		Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF
	Note	AUD	EUR	EUR	EUR
ACTIFS					
Investissements à la valeur de marché		42 282 025	114 786 560	8 734 215	504 935 314
Liquidités en banque		40 997	8 317	202	284 783
Montant à recevoir du courtier		0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		0	0	0	0
Produits à recevoir pour Investissement vendu		0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	0	1 952	0
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	0	0	54 019	0
Intérêts à recevoir, nets		211 945	0	80 223	3 469 015
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Plus-value latente sur Swap	4	0	3 369 982	44 115	0
Autres actifs		0	0	0	1 710
TOTAL DES ACTIFS		42 534 967	118 164 859	8 914 726	508 690 822
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	0	0	0
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les Investissements achetés		0	0	0	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		0	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	0	0	0
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	2 006 086	0	0
Moins-value latente sur Swap	4	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	5 210	4 889	1 381	40 862
Commissions Fixes	10	3 473	9 779	1 381	41 437
Autres engagements		0	0	0	66
TOTAL DES ENGAGEMENTS		8 683	2 020 754	2 762	82 365
TOTAL DES ACTIFS NETS		42 526 284	116 144 105	8 911 964	508 608 457

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

	Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF
Note	JPY	USD	EUR	EUR
ACTIFS				
Investissements à la valeur de marché	141 011 310 914	868 176 046	392 597 245	198 526 678
Liquidités en banque	327 525 751	0	2 529 882	13 082
Montant à recevoir du courtier	0	0	26 799	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues	0	0	0	0
Produits à recevoir pour Investissement vendu	0	0	514 034	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	75 627	0	0
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	799 024 088	0	17 033 788
Intérêts à recevoir, nets	260 842 825	3 597 096	4 598 660	852 147
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Plus-value latente sur Swap	4	0	0	0
Autres actifs	0	0	3 765	0
TOTAL DES ACTIFS	141 599 679 490	1 670 872 857	400 270 385	216 425 695
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	0	243 803	0	0
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées	0	0	0	0
Montant à payer pour les Investissements achetés	0	0	0	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant	0	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap	0	0	0	107
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	0	0
Moins-value latente sur Swap	4	789 211 969	0	14 661 986
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	6 350	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Commission de la Société de Gestion	10	5 593 868	32 575	41 819
Commissions Fixes	10	11 187 736	32 575	16 727
Autres engagements	0	59	297	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS	16 781 604	789 603 325	71 797	14 720 639
TOTAL DES ACTIFS NETS	141 582 897 886	881 269 532	400 198 588	201 705 056

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

État de l'Actif net au 30 juin 2020 (suite)

	Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF	COMBINÉ
Note	USD	USD	EUR
ACTIFS			
Investissements à la valeur de marché	63 666 546	20 900 207	20 201 793 202
Liquidités en banque	1 360 374	363 927	34 622 082
Montant à recevoir du courtier	0	0	615 362
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues	0	0	41 815 942
Produits à recevoir pour Investissement vendu	0	0	514 034
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	8 682 603
Produits à recevoir de la contrepartie de swap	4	0	780 172 360
Intérêts à recevoir, nets	790 888	175 529	130 483 066
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	38 323 638
Plus-value latente sur Swap	4	0	16 847 314
Autres actifs	0	0	104 721
TOTAL DES ACTIFS	65 817 808	21 439 663	21 253 974 324
ENGAGEMENTS			
Découvert bancaire	0	0	278 692
Montant à payer pour les parts de fonds rachetées	0	0	3 139 359
Montant à payer pour les Investissements achetés	0	0	46 377 776
Montant à payer sur les contrats de change au comptant	0	0	3 754
Montant à payer sur les conventions de swap	0	0	6 814 450
Montant à payer à la contrepartie de swap	4	0	14 438 047
Moins-value latente sur Swap	4	0	757 136 143
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	128 470
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	38 326
Commission de la Société de Gestion	10	35 422	3 273
Commissions Fixes	10	21 253	1 637
Autres engagements	0	0	2 483 795
TOTAL DES ENGAGEMENTS	56 675	4 910	833 773 918
TOTAL DES ACTIFS NETS	65 761 133	21 434 753	20 420 200 406

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Autriche					
Austria Zero Coupon 16 - 15.07.23	3 519 000	EUR	3 552 718	3 582 366	0,10
Austria Zero Coupon 16 - 15.07.23	1 245 000	EUR	1 268 110	1 267 419	0,04
Austria Zero Coupon 17 - 20.09.22	3 531 000	EUR	3 574 054	3 579 083	0,10
Austria Zero Coupon 19 - 15.07.24	2 841 000	EUR	2 905 680	2 905 619	0,08
Austria Zero Coupon 20 - 20.02.30	2 830 000	EUR	2 901 870	2 891 847	0,08
Austria Zero Coupon 20 - 20.04.23	2 647 000	EUR	2 690 401	2 690 429	0,07
Austria 0.50% 17 - 20.04.27	4 904 000	EUR	5 062 877	5 215 343	0,14
Austria 0.50% 19 - 20.02.29	5 359 000	EUR	5 620 362	5 730 950	0,16
Austria 0.75% 16 - 20.10.26	6 309 000	EUR	6 625 756	6 794 900	0,19
Austria 0.75% 18 - 20.02.28	4 821 000	EUR	5 025 271	5 235 027	0,15
Austria 0.75% 20 - 20.03.51	1 510 000	EUR	1 689 201	1 693 054	0,05
Austria 1.20% 15 - 20.10.25	5 586 000	EUR	6 002 397	6 103 180	0,17
Austria 1.50% 16 - 20.02.47	3 704 000	EUR	4 370 398	4 871 079	0,13
Austria 1.50% 16 - 11.02.86	1 254 000	EUR	1 539 671	1 906 588	0,05
Austria 1.65% 14 - 21.10.24	5 411 000	EUR	5 841 903	5 937 286	0,16
Austria 1.75% 13 - 20.10.23	5 967 000	EUR	6 380 655	6 435 810	0,18
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	3 019 000	EUR	4 721 859	5 950 537	0,16
Austria 2.40% 13 - 23.05.34	4 056 000	EUR	5 128 886	5 425 468	0,15
Austria 3.15% 12 - 20.06.44	3 567 000	EUR	5 549 803	6 028 471	0,17
Austria 3.40% 12 - 22.11.22	5 336 000	EUR	5 831 766	5 852 280	0,16
Austria 3.50% 06 - 15.09.21	7 798 000	EUR	8 181 998	8 181 356	0,23
Austria 3.65% 11 - 20.04.22	2 350 000	EUR	2 530 189	2 531 618	0,07
Austria 3.65% 11 - 20.04.22	1 990 000	EUR	2 134 439	2 143 796	0,06
Austria 3.80% 12 - 26.01.62	1 912 000	EUR	3 795 370	4 392 828	0,12
Austria 4.15% 07 - 15.03.37	6 992 000	EUR	11 030 530	11 741 305	0,33
Austria 4.85% 09 - 15.03.26	4 485 000	EUR	5 791 402	5 875 058	0,16
Austria 6.25% 97 - 15.07.27	4 928 000	EUR	7 115 612	7 265 709	0,20
			126 863 178	132 228 406	3,66
Belgique					
Belgium Zero Coupon 20 - 22.10.27	4 013 000	EUR	4 070 174	4 101 968	0,11
Belgium 0.10% 20 - 22.06.30	4 239 000	EUR	4 328 110	4 341 667	0,12
Belgium 0.20% 16 - 22.10.23	2 725 000	EUR	2 776 367	2 795 991	0,08
Belgium 0.20% 16 - 22.10.23	1 976 000	EUR	2 017 555	2 027 478	0,06
Belgium 0.40% 20 - 22.06.40	2 537 000	EUR	2 605 866	2 536 779	0,07
Belgium 0.50% 17 - 22.10.24	5 709 000	EUR	5 886 924	5 962 256	0,17
Belgium 0.80% 15 - 22.06.25	4 711 000	EUR	4 924 191	5 016 603	0,14
Belgium 0.80% 15 - 22.06.25	3 267 000	EUR	3 425 927	3 478 930	0,10
Belgium 0.80% 17 - 22.06.27	7 124 000	EUR	7 460 537	7 694 810	0,21
Belgium 0.80% 18 - 22.06.28	6 562 000	EUR	6 849 821	7 136 751	0,20
Belgium 0.80% 18 - 22.06.28	711 000	EUR	757 203	773 275	0,02
Belgium 0.90% 19 - 22.06.29	7 705 000	EUR	8 300 033	8 483 417	0,23
Belgium 1.00% 15 - 22.06.31	6 915 000	EUR	7 291 557	7 727 734	0,21
Belgium 1.00% 16 - 22.06.26	7 765 000	EUR	8 212 988	8 425 491	0,23
Belgium 1.25% 18 - 22.04.33	3 648 000	EUR	3 976 985	4 224 878	0,12
Belgium 1.45% 17 - 22.06.37	2 519 000	EUR	2 839 293	3 016 876	0,08
Belgium 1.60% 16 - 22.06.47	5 483 000	EUR	6 203 404	6 909 315	0,19
Belgium 1.70% 19 - 22.06.50	3 736 000	EUR	4 343 960	4 864 983	0,13
Belgium 1.90% 15 - 22.06.38	4 205 100	EUR	4 999 282	5 384 324	0,15

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Belgique (suite)					
Belgium 2.15% 16 - 22.06.66	2 510 600	EUR	3 511 369	3 947 001	0,11
Belgium 2.15% 16 - 22.06.66	860 000	EUR	1 103 894	1 352 036	0,04
Belgium 2.25% 13 - 22.06.23	6 671 000	EUR	7 194 832	7 241 268	0,20
Belgium 2.25% 17 - 22.06.57	2 599 700	EUR	3 418 691	3 962 845	0,11
Belgium 2.60% 14 - 22.06.24	4 597 000	EUR	5 113 975	5 178 452	0,14
Belgium 2.60% 14 - 22.06.24	2 955 000	EUR	3 309 620	3 328 763	0,09
Belgium 3.00% 14 - 22.06.34	1 987 000	EUR	2 675 182	2 789 468	0,08
Belgium 3.00% 14 - 22.06.34	1 825 000	EUR	2 313 667	2 562 043	0,07
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	2 594 000	EUR	4 302 923	4 570 570	0,13
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	2 268 000	EUR	3 513 499	3 996 165	0,11
Belgium 4.00% 06 - 28.03.22	7 122 000	EUR	7 685 282	7 699 754	0,21
Belgium 4.00% 12 - 28.03.32	4 226 000	EUR	6 030 649	6 228 467	0,17
Belgium 4.25% 10 - 28.03.41	8 738 700	EUR	14 358 348	15 412 256	0,43
Belgium 4.25% 11 - 28.09.21	6 315 000	EUR	6 693 401	6 696 231	0,19
Belgium 4.25% 11 - 28.09.21	1 873 000	EUR	1 981 851	1 986 072	0,05
Belgium 4.25% 12 - 28.09.22	3 746 000	EUR	4 145 901	4 158 559	0,12
Belgium 4.25% 12 - 28.09.22	4 118 200	EUR	4 552 564	4 571 751	0,13
Belgium 4.50% 11 - 28.03.26	5 452 000	EUR	6 890 678	7 012 376	0,19
Belgium 5.00% 04 - 28.03.35	9 873 000	EUR	16 027 695	16 874 569	0,47
Belgium 5.50% 98 - 28.03.28	9 729 000	EUR	13 652 839	14 150 657	0,39
			209 747 037	218 622 829	6,05
Finlande					
Finland Zero Coupon 16 - 15.09.23	2 863 000	EUR	2 873 701	2 919 225	0,08
Finland Zero Coupon 17 - 15.04.22	2 654 000	EUR	2 681 924	2 683 236	0,07
Finland Zero Coupon 19 - 15.09.24	1 970 000	EUR	2 016 661	2 018 872	0,06
Finland 0.125% 20 - 15.04.36	1 506 000	EUR	1 560 581	1 522 321	0,04
Finland 0.50% 16 - 15.04.26	3 325 000	EUR	3 455 289	3 516 653	0,10
Finland 0.50% 17 - 15.09.27	3 670 000	EUR	3 811 741	3 910 468	0,11
Finland 0.50% 18 - 15.09.28	2 171 000	EUR	2 243 934	2 322 282	0,06
Finland 0.50% 19 - 15.09.29	3 114 000	EUR	3 256 372	3 335 626	0,09
Finland 0.75% 15 - 15.04.31	2 194 000	EUR	2 290 615	2 413 586	0,07
Finland 0.875% 15 - 15.09.25	2 400 000	EUR	2 531 598	2 578 135	0,07
Finland 1.125% 18 - 15.04.34	2 454 000	EUR	2 681 179	2 839 278	0,08
Finland 1.375% 17 - 15.04.47	1 814 000	EUR	2 106 635	2 378 294	0,07
Finland 1.50% 13 - 15.04.23	2 523 000	EUR	2 662 897	2 673 607	0,07
Finland 1.625% 12 - 15.09.22	2 528 000	EUR	2 638 974	2 655 058	0,07
Finland 2.00% 14 - 15.04.24	2 591 000	EUR	2 820 188	2 850 946	0,08
Finland 2.625% 12 - 07.04.42	2 245 000	EUR	3 242 511	3 471 299	0,10
Finland 2.75% 12 - 07.04.28	2 649 000	EUR	3 221 802	3 315 012	0,09
Finland 4.00% 09 - 07.04.25	3 109 000	EUR	3 760 656	3 832 642	0,11
			49 857 258	51 236 540	1,42
France					
France OAT Zero Coupon 16 - 25.05.22	16 061 000	EUR	16 205 379	16 249 556	0,45
France OAT Zero Coupon 17 - 25.03.23	20 188 000	EUR	20 428 513	20 532 306	0,57
France OAT Zero Coupon 18 - 25.03.24	18 352 000	EUR	18 572 320	18 754 898	0,52
France OAT Zero Coupon 19 - 25.02.22	14 770 000	EUR	14 920 592	14 919 663	0,41
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	19 008 000	EUR	19 432 628	19 486 918	0,54
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	20 289 000	EUR	20 564 749	20 670 825	0,57

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.23	5 318 000	EUR	5 408 333	5 402 264	0,15
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	4 593 000	EUR	4 686 773	4 710 645	0,13
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	18 399 000	EUR	18 764 937	19 199 962	0,53
France OAT 0.50% 15 - 25.05.25	19 223 000	EUR	19 888 212	20 210 991	0,56
France OAT 0.50% 16 - 25.05.26	17 993 000	EUR	18 652 395	19 033 747	0,53
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	16 669 000	EUR	17 535 298	17 784 909	0,49
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	16 534 000	EUR	17 207 273	17 943 487	0,50
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	3 362 000	EUR	3 590 210	3 648 603	0,10
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	19 430 000	EUR	20 359 343	21 131 021	0,58
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	789 000	EUR	849 965	858 074	0,02
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	4 247 000	EUR	4 505 392	4 432 738	0,12
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	14 017 040	EUR	14 932 374	15 168 222	0,42
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	3 596 000	EUR	3 803 431	3 891 330	0,11
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	17 104 857	EUR	18 263 898	18 753 011	0,52
France OAT 1.25% 16 - 25.05.36	7 280 000	EUR	8 040 586	8 516 030	0,24
France OAT 1.25% 16 - 25.05.36	9 167 000	EUR	10 268 718	10 723 414	0,30
France OAT 1.25% 18 - 25.05.34	16 012 000	EUR	17 952 699	18 623 719	0,51
France OAT 1.50% 15 - 25.05.31	23 121 000	EUR	25 961 870	27 214 728	0,75
France OAT 1.50% 19 - 25.05.50	13 199 000	EUR	15 804 005	16 622 458	0,46
France OAT 1.75% 13 - 25.05.23	18 919 000	EUR	20 124 162	20 223 089	0,56
France OAT 1.75% 13 - 25.05.23	2 658 000	EUR	2 830 281	2 841 216	0,08
France OAT 1.75% 14 - 25.11.24	18 656 000	EUR	20 261 700	20 577 755	0,57
France OAT 1.75% 16 - 25.05.66	6 514 000	EUR	7 915 025	9 301 958	0,26
France OAT 1.75% 17 - 25.06.39	12 846 500	EUR	15 444 802	16 363 744	0,45
France OAT 2.00% 17 - 25.05.48	13 328 000	EUR	16 655 282	18 466 604	0,51
France OAT 2.25% 12 - 25.10.22	19 596 100	EUR	20 845 750	20 907 300	0,58
France OAT 2.25% 13 - 25.05.24	17 532 000	EUR	19 312 520	19 491 075	0,54
France OAT 2.50% 14 - 25.05.30	20 856 000	EUR	25 308 563	26 451 204	0,73
France OAT 2.75% 12 - 25.10.27	21 569 600	EUR	25 739 526	26 577 414	0,74
France OAT 3.00% 12 - 25.04.22	23 401 000	EUR	24 895 516	24 946 713	0,69
France OAT 3.25% 11 - 25.10.21	18 757 000	EUR	19 697 931	19 712 810	0,55
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	13 020 000	EUR	19 609 675	21 571 347	0,60
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	15 390 000	EUR	18 669 970	18 998 764	0,53
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	5 494 000	EUR	6 635 887	6 782 275	0,19
France OAT 4.00% 05 - 25.04.55	8 297 000	EUR	15 386 311	17 143 428	0,47
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	13 304 000	EUR	20 861 122	22 301 556	0,62
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	7 761 400	EUR	14 934 050	16 930 356	0,47
France OAT 4.25% 07 - 25.10.23	19 736 000	EUR	22 630 415	22 956 074	0,63
France OAT 4.25% 07 - 25.10.23	2 707 000	EUR	3 154 927	3 148 667	0,09
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	18 019 000	EUR	30 939 006	33 131 508	0,92
France OAT 4.75% 04 - 25.04.35	14 617 000	EUR	23 281 291	24 681 648	0,68
France OAT 5.50% 98 - 25.04.29	18 904 000	EUR	27 637 344	28 647 761	0,79
France OAT 5.75% 01 - 25.10.32	16 238 000	EUR	26 578 007	27 902 090	0,77
France OAT 6.00% 94 - 25.10.25	15 338 000	EUR	20 369 100	20 733 100	0,57
France OAT 8.25% 92 - 25.04.22	560 000	EUR	647 889	650 338	0,02
France OAT 8.50% 92 - 25.04.23	5 169 000	EUR	6 479 951	6 507 140	0,18
			833 445 896	862 430 453	23,87

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne					
Bundesobligation Zero Coupon 16 - 10.08.21	10 951 000	EUR	11 041 564	11 041 710	0,31
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 04.08.22	10 498 000	EUR	10 611 118	10 626 154	0,29
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 10.07.22	9 829 570	EUR	9 972 572	9 987 313	0,28
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 14.04.23	9 467 000	EUR	9 617 976	9 659 633	0,27
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 13.10.23	8 912 000	EUR	9 077 217	9 127 142	0,25
Bundesobligation Zero Coupon 19 - 04.05.24	12 126 000	EUR	12 417 117	12 458 556	0,34
Bundesobligation Zero Coupon 19 - 18.10.24	11 398 000	EUR	11 765 050	11 751 870	0,32
Bundesobligation Zero Coupon 20 - 04.11.25	7 943 000	EUR	8 216 995	8 215 445	0,23
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	14 948 000	EUR	15 313 543	15 590 203	0,43
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	13 428 000	EUR	14 089 735	14 101 899	0,39
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	4 018 000	EUR	4 091 012	4 036 214	0,11
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	12 434 000	EUR	13 078 937	13 050 214	0,36
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	3 749 000	EUR	3 874 483	3 899 548	0,11
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	2 007 000	EUR	2 092 228	2 099 768	0,06
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	15 245 000	EUR	15 806 075	16 198 498	0,45
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	12 960 000	EUR	13 519 906	13 876 855	0,38
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	13 375 000	EUR	14 070 806	14 346 872	0,40
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	13 803 000	EUR	14 438 952	14 595 614	0,40
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	15 250 000	EUR	15 998 700	16 299 886	0,45
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	14 664 000	EUR	15 383 186	15 893 026	0,44
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	12 781 000	EUR	13 530 735	13 904 578	0,38
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 14 - 15.08.24	11 478 000	EUR	12 204 082	12 305 299	0,34
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	13 753 000	EUR	14 809 026	14 982 381	0,41
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	11 278 600	EUR	14 285 271	15 389 814	0,43
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 12 - 09.04.22	10 286 000	EUR	10 756 618	10 786 921	0,30
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 13 - 15.02.23	9 990 000	EUR	10 548 403	10 581 007	0,29
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 13 - 15.05.23	11 315 000	EUR	11 985 077	12 046 664	0,33
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 14 - 15.05.24	11 101 000	EUR	11 945 943	12 072 595	0,33
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 12 - 07.04.22	13 353 000	EUR	13 989 295	14 011 852	0,39
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 14 - 15.02.24	11 101 000	EUR	12 038 665	12 113 295	0,34
Bundesrepublik Deutschland 2.00% 11 - 01.04.22	11 119 000	EUR	11 572 442	11 577 481	0,32
Bundesrepublik Deutschland 2.00% 13 - 15.08.23	11 623 800	EUR	12 574 510	12 626 979	0,35
Bundesrepublik Deutschland 2.25% 11 - 09.04.21	7 844 000	EUR	8 110 788	8 112 592	0,22
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 07.04.44	14 297 586	EUR	21 563 251	23 412 726	0,65
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	15 286 800	EUR	23 547 431	25 670 357	0,71
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 07.04.42	9 877 000	EUR	16 416 410	17 426 257	0,48
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 11 - 07.04.21	9 770 000	EUR	10 157 070	10 152 672	0,28
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 01.04.37	13 773 000	EUR	22 659 626	23 727 118	0,66
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 07.04.39	9 250 000	EUR	16 565 302	17 275 341	0,48
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 07.04.28	7 027 000	EUR	9 883 347	10 101 435	0,28
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 07.04.34	12 299 100	EUR	20 514 143	21 360 001	0,59
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 07.04.40	3 363 500	EUR	6 129 278	6 769 931	0,19

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 07.04.40	6 971 000	EUR	13 587 075	14 030 976	0,39
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 01.04.31	10 679 000	EUR	17 139 627	17 540 007	0,49
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 01.04.28	8 440 000	EUR	12 229 315	12 475 378	0,35
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 94 - 01.04.24	6 291 000	EUR	7 812 023	7 846 827	0,22
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 01.04.30	5 797 000	EUR	9 421 659	9 632 816	0,27
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 07.04.27	7 133 000	EUR	10 589 225	10 779 086	0,30
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 06.11.21	6 908 000	EUR	6 957 958	6 950 588	0,19
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 09.10.21	6 812 000	EUR	6 877 154	6 865 031	0,19
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 12.10.21	7 880 000	EUR	7 959 503	7 958 474	0,22
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 03.11.22	6 824 000	EUR	6 913 858	6 901 998	0,19
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 06.10.22	2 082 000	EUR	2 109 023	2 110 306	0,06
			631 860 305	646 355 203	17,89
Irlande					
Ireland Zero Coupon 17 - 18.10.22	2 621 000	EUR	2 642 125	2 652 777	0,07
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	3 137 000	EUR	3 192 840	3 230 332	0,09
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	1 804 000	EUR	1 836 695	1 843 921	0,05
Ireland 0.80% 15 - 15.03.22	3 483 000	EUR	3 551 091	3 562 262	0,10
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	4 080 000	EUR	4 237 506	4 429 268	0,12
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	5 502 000	EUR	5 770 265	5 929 691	0,16
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	4 780 000	EUR	5 162 914	5 289 757	0,15
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	2 374 000	EUR	2 554 088	2 730 266	0,08
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	2 593 000	EUR	2 819 864	2 961 504	0,08
Ireland 1.50% 19 - 15.05.30	2 368 000	EUR	2 647 967	2 919 651	0,08
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	2 932 000	EUR	3 214 798	3 594 837	0,10
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	4 298 000	EUR	5 120 584	5 806 041	0,16
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	4 642 100	EUR	5 444 625	5 767 500	0,16
Ireland 3.40% 14 - 18.03.24	4 027 000	EUR	4 550 943	4 607 195	0,13
Ireland 3.90% 13 - 20.03.23	3 465 400	EUR	3 850 527	3 884 546	0,11
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	5 813 000	EUR	7 291 549	7 415 187	0,20
			63 888 381	66 624 735	1,84
Italie					
Italy 5.125% 04 - 31.07.24	1 684 000	EUR	1 946 747	1 975 675	0,05
Italy 5.20% 04 - 31.07.34	1 077 000	EUR	1 299 857	1 493 584	0,04
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.05% 19 - 15.01.23	7 586 000	EUR	7 565 092	7 561 591	0,21
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 16 - 11.01.21	8 016 000	EUR	7 999 036	8 062 012	0,22
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 19 - 02.01.25	9 452 000	EUR	9 320 025	9 347 698	0,26
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 19 - 02.01.25	367 000	EUR	363 662	362 950	0,01
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.45% 16 - 06.01.21	7 280 000	EUR	7 297 243	7 317 686	0,20
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.60% 20 - 15.06.23	7 089 000	EUR	7 071 595	7 162 323	0,20
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.65% 16 - 15.10.23	8 122 000	EUR	8 074 450	8 216 923	0,23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.85% 19 - 15.01.27	8 014 000	EUR	7 926 999	7 982 425	0,22
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.90% 17 - 08.01.22	9 293 000	EUR	9 342 518	9 448 797	0,26
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 16 - 15.03.23	8 270 000	EUR	8 292 828	8 432 464	0,23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 18 - 03.01.23	8 624 000	EUR	8 589 996	8 792 923	0,24
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 20 - 08.01.30	5 860 000	EUR	5 467 288	5 701 194	0,16
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	5 017 000	EUR	5 058 718	5 111 401	0,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	1 790 000	EUR	1 816 622	1 823 681	0,05
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.20% 17 - 04.01.22	8 178 000	EUR	8 264 440	8 338 309	0,23

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.25% 16 - 12.01.26	9 819 000	EUR	9 712 648	10 057 330	0,28
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 15 - 15.04.22	8 775 000	EUR	8 877 157	8 973 820	0,25
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 19 - 04.01.30	11 104 000	EUR	11 295 590	11 237 470	0,31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 15 - 15.09.22	8 370 000	EUR	8 543 558	8 612 041	0,24
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 17 - 15.11.24	8 109 000	EUR	8 213 812	8 423 555	0,23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 18 - 15.05.25	6 835 000	EUR	6 782 829	7 092 274	0,20
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 18 - 15.05.25	1 243 000	EUR	1 265 703	1 289 787	0,04
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 20 - 03.01.36	5 022 000	EUR	4 912 490	4 876 287	0,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.50% 15 - 06.01.25	7 371 000	EUR	7 419 124	7 670 964	0,21
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.50% 15 - 06.01.25	2 073 000	EUR	2 111 712	2 157 361	0,06
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.60% 16 - 06.01.26	9 533 000	EUR	9 695 690	9 973 627	0,28
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.65% 15 - 03.01.32	10 783 000	EUR	10 456 098	11 086 990	0,31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.75% 19 - 07.01.24	8 215 000	EUR	8 490 700	8 617 714	0,24
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.75% 19 - 07.01.24	731 000	EUR	769 845	766 835	0,02
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.85% 17 - 15.05.24	7 487 000	EUR	7 647 704	7 885 168	0,22
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.85% 20 - 07.01.25	4 898 000	EUR	5 037 145	5 170 206	0,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 15 - 12.01.25	9 586 000	EUR	9 813 365	10 232 488	0,28
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 18 - 02.01.28	11 547 000	EUR	11 815 949	12 368 511	0,34
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.05% 17 - 08.01.27	9 795 000	EUR	10 129 849	10 513 296	0,29
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.10% 19 - 15.07.26	8 051 000	EUR	8 545 918	8 641 492	0,24
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.15% 14 - 15.12.21	8 998 000	EUR	9 205 389	9 288 455	0,26
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.20% 17 - 06.01.27	8 660 000	EUR	8 951 536	9 382 449	0,26
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.25% 16 - 09.01.36	7 738 000	EUR	7 634 652	8 337 979	0,23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.30% 18 - 15.10.21	8 210 000	EUR	8 375 189	8 463 186	0,23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 17 - 09.01.33	7 959 000	EUR	8 259 789	8 822 995	0,24
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 18 - 10.01.23	9 260 000	EUR	9 625 960	9 898 986	0,27
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 20 - 09.01.50	6 534 000	EUR	6 844 948	6 870 566	0,19
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.50% 14 - 12.01.24	10 120 000	EUR	10 609 898	10 959 494	0,30
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.50% 18 - 15.11.25	8 302 000	EUR	8 588 854	9 069 974	0,25
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.70% 16 - 03.01.47	8 742 000	EUR	8 905 813	9 721 555	0,27
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.80% 16 - 03.01.67	4 773 000	EUR	4 773 133	5 314 438	0,15
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.80% 18 - 12.01.28	9 473 000	EUR	9 973 124	10 767 164	0,30
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.95% 18 - 09.01.38	7 400 000	EUR	7 929 143	8 643 995	0,24
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.00% 19 - 08.01.29	10 118 000	EUR	11 294 925	11 721 988	0,32
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.10% 19 - 03.01.40	5 421 000	EUR	6 167 024	6 454 108	0,18
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.25% 15 - 09.01.46	8 294 000	EUR	9 243 324	10 111 405	0,28
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.35% 19 - 03.01.35	7 686 000	EUR	8 818 714	9 370 884	0,26
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	7 918 000	EUR	8 813 580	10 004 277	0,28
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	341 000	EUR	439 469	430 849	0,01
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.50% 14 - 03.01.30	12 872 000	EUR	14 549 896	15 536 893	0,43
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.75% 06 - 08.01.21	14 386 000	EUR	14 888 779	14 988 917	0,42
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.75% 14 - 09.01.24	9 982 000	EUR	11 080 825	11 291 417	0,31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.85% 19 - 09.01.49	6 589 000	EUR	8 048 390	8 910 467	0,25
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.00% 05 - 02.01.37	14 028 000	EUR	17 184 645	18 428 093	0,51
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 10 - 03.01.26	11 655 000	EUR	13 578 044	14 048 974	0,39
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 05.01.23	3 310 000	EUR	3 672 460	3 707 332	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 05.01.23	6 593 000	EUR	7 161 166	7 384 424	0,20
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 03.01.24	12 393 000	EUR	13 894 979	14 220 281	0,39

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 08 - 08.01.23	12 418 000	EUR	13 793 625	14 115 050	0,39
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 11 - 09.01.21	12 336 000	EUR	12 947 471	13 032 614	0,36
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 13 - 09.01.28	12 212 000	EUR	15 013 505	15 706 316	0,43
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 13 - 09.01.44	9 040 000	EUR	12 374 288	13 546 943	0,38
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 03 - 08.01.34	12 247 000	EUR	16 198 084	17 403 041	0,48
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 07 - 08.01.39	11 281 000	EUR	15 393 193	16 860 730	0,47
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 09 - 03.01.25	12 698 000	EUR	14 826 586	15 245 985	0,42
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 09 - 09.01.40	11 198 000	EUR	15 543 937	16 815 805	0,47
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 11 - 03.01.22	10 376 000	EUR	11 115 746	11 239 607	0,31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.25% 98 - 11.01.29	14 242 000	EUR	18 386 986	19 335 896	0,54
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.50% 12 - 09.01.22	9 790 000	EUR	10 761 035	10 929 384	0,30
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.50% 12 - 11.01.22	10 689 000	EUR	11 862 889	12 011 129	0,33
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.75% 02 - 02.01.33	10 501 000	EUR	14 777 684	15 574 453	0,43
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.00% 00 - 05.01.31	15 194 000	EUR	21 054 767	22 250 170	0,62
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.50% 97 - 11.01.27	13 453 000	EUR	17 689 312	18 608 067	0,52
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 7.25% 97 - 11.01.26	6 168 000	EUR	8 251 758	8 583 489	0,24
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9.00% 93 - 11.01.23	6 819 000	EUR	8 535 390	8 772 372	0,24
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 19 - 29.06.21	7 261 000	EUR	7 243 488	7 266 166	0,20
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 19 - 29.11.21	9 234 000	EUR	9 207 444	9 231 595	0,26
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 20 - 30.05.22	1 961 000	EUR	1 945 843	1 954 565	0,05
			772 670 681	803 413 774	22,23
Lettonie					
Latvia 1.875% 19 - 19.02.49	1 160 000	EUR	1 276 665	1 554 400	0,04
Latvia 2.875% 14 - 30.04.24	300 000	EUR	327 279	336 023	0,01
			1 603 944	1 890 423	0,05
Lituanie					
Lithuania 0.75% 20 - 05.06.30	621 000	EUR	652 615	658 726	0,02
Lithuania 0.95% 17 - 26.05.27	565 000	EUR	605 113	612 509	0,02
Lithuania 2.125% 14 - 29.10.26	450 000	EUR	500 542	519 008	0,01
Lithuania 2.125% 15 - 22.10.35	584 000	EUR	632 538	740 877	0,02
			2 390 808	2 531 120	0,07
Luxembourg					
Luxembourg Zero Coupon 19 - 13.11.26	1 109 000	EUR	1 129 559	1 140 862	0,03
Luxembourg Zero Coupon 20 - 28.04.25	740 000	EUR	754 351	757 849	0,02
Luxembourg Zero Coupon 20 - 28.04.30	700 000	EUR	715 462	719 483	0,02
Luxembourg 0.625% 17 - 02.01.27	700 000	EUR	717 353	748 147	0,02
Luxembourg 2.125% 13 - 07.10.23	805 000	EUR	864 862	870 507	0,03
			4 181 587	4 236 848	0,12
Pays-Bas					
Netherlands Zero Coupon 16 - 15.01.22	7 800 000	EUR	7 866 230	7 874 561	0,22
Netherlands Zero Coupon 17 - 15.01.24	7 661 000	EUR	7 758 817	7 835 862	0,22
Netherlands Zero Coupon 20 - 15.07.30	5 488 000	EUR	5 652 765	5 661 461	0,16
Netherlands Zero Coupon 20 - 15.01.27	2 477 000	EUR	2 546 821	2 558 534	0,07
Netherlands 0.25% 15 - 15.07.25	7 218 000	EUR	7 415 016	7 530 251	0,21
Netherlands 0.25% 15 - 15.07.25	292 000	EUR	294 785	304 632	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Netherlands 0.25% 19 - 15.07.29	1 288 000	EUR	1 370 033	1 362 509	0,04
Netherlands 0.25% 19 - 15.07.29	4 951 000	EUR	5 118 144	5 237 408	0,14
Netherlands 0.50% 16 - 15.07.26	5 471 000	EUR	5 749 945	5 823 934	0,16
Netherlands 0.50% 16 - 15.07.26	2 835 000	EUR	2 962 970	3 017 886	0,08
Netherlands 0.50% 19 - 15.01.40	3 754 000	EUR	4 031 219	4 154 178	0,11
Netherlands 0.75% 17 - 15.07.27	7 798 000	EUR	8 251 904	8 486 160	0,23
Netherlands 0.75% 18 - 15.07.28	6 188 000	EUR	6 606 425	6 790 309	0,19
Netherlands 1.75% 13 - 15.07.23	943 000	EUR	1 013 974	1 012 270	0,03
Netherlands 1.75% 13 - 15.07.23	7 915 000	EUR	8 416 571	8 496 413	0,23
Netherlands 2.00% 14 - 15.07.24	8 004 000	EUR	8 788 495	8 866 843	0,25
Netherlands 2.25% 12 - 15.07.22	7 480 590	EUR	7 911 885	7 926 228	0,22
Netherlands 2.50% 12 - 15.01.33	6 813 000	EUR	8 812 942	9 187 289	0,25
Netherlands 2.75% 14 - 15.01.47	8 291 400	EUR	13 071 495	14 341 044	0,40
Netherlands 3.25% 11 - 15.07.21	8 377 000	EUR	8 716 107	8 712 662	0,24
Netherlands 3.75% 06 - 15.01.23	2 339 000	EUR	2 589 972	2 603 787	0,07
Netherlands 3.75% 10 - 15.01.42	8 032 000	EUR	13 643 664	14 652 343	0,41
Netherlands 4.00% 05 - 15.01.37	7 816 000	EUR	12 472 084	13 211 537	0,37
Netherlands 5.50% 98 - 15.01.28	6 440 400	EUR	9 142 649	9 380 965	0,26
Netherlands 7.50% 93 - 15.01.23	4 146 886	EUR	5 000 474	5 015 721	0,14
			165 205 386	170 044 787	4,71
Portugal					
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 0.475% 20 - 18.10.30	2 602 000	EUR	2 616 361	2 601 331	0,07
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 0.70% 20 - 15.10.27	2 467 000	EUR	2 489 704	2 557 388	0,07
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.95% 19 - 15.06.29	3 549 000	EUR	3 951 509	4 041 903	0,11
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.95% 19 - 15.06.29	2 016 000	EUR	2 283 913	2 295 992	0,06
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.125% 18 - 17.10.28	5 686 600	EUR	6 131 723	6 536 599	0,18
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.20% 15 - 17.10.22	5 105 000	EUR	5 368 183	5 420 234	0,15
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.25% 18 - 18.04.34	3 558 000	EUR	4 109 776	4 243 965	0,12
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.875% 15 - 15.10.25	7 094 000	EUR	7 918 076	8 205 488	0,23
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.875% 16 - 21.07.26	5 431 000	EUR	6 161 686	6 380 701	0,18
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 3.875% 14 - 15.02.30	1 880 000	EUR	2 439 803	2 488 085	0,07
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 3.875% 14 - 15.02.30	1 309 000	EUR	1 572 488	1 732 396	0,05
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.10% 06 - 15.04.37	4 558 000	EUR	6 107 294	6 780 350	0,19
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.10% 15 - 15.02.45	1 946 000	EUR	2 655 182	3 104 785	0,08

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Portugal (suite)					
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.125% 17 - 14.04.27	4 735 000	EUR	5 744 389	6 022 105	0,17
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.95% 08 - 25.10.23	6 316 000	EUR	7 309 830	7 436 921	0,20
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 5.65% 13 - 15.02.24	5 839 000	EUR	6 921 445	7 110 267	0,20
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 5.65% 13 - 15.02.24	539 000	EUR	650 319	656 351	0,02
			74 431 681	77 614 861	2,15
Slovaquie					
Slovakia Zero Coupon 16 - 13.11.23	901 000	EUR	890 364	911 614	0,03
Slovakia 0.25% 20 - 14.05.25	993 000	EUR	1 016 723	1 012 729	0,03
Slovakia 0.625% 16 - 22.05.26	1 313 000	EUR	1 342 030	1 376 904	0,04
Slovakia 0.75% 19 - 04.09.30	1 049 000	EUR	1 114 572	1 125 100	0,03
Slovakia 1.00% 18 - 06.12.28	1 263 000	EUR	1 334 764	1 374 990	0,04
Slovakia 1.00% 20 - 10.09.30	700 000	EUR	726 547	772 572	0,02
Slovakia 1.00% 20 - 14.05.32	1 300 000	EUR	1 409 146	1 440 336	0,04
Slovakia 1.375% 15 - 21.01.27	1 351 000	EUR	1 433 129	1 484 374	0,04
Slovakia 1.625% 16 - 21.01.31	1 398 000	EUR	1 476 599	1 631 843	0,04
Slovakia 1.875% 17 - 03.09.37	1 407 000	EUR	1 550 043	1 756 629	0,05
Slovakia 2.00% 17 - 17.10.47	868 000	EUR	1 028 937	1 158 138	0,03
Slovakia 3.00% 13 - 28.02.23	1 562 600	EUR	1 700 852	1 701 453	0,05
Slovakia 3.375% 12 - 15.11.24	1 393 000	EUR	1 598 578	1 618 492	0,04
Slovakia 3.625% 14 - 16.01.29	1 458 000	EUR	1 819 767	1 916 191	0,05
Slovakia 3.875% 13 - 02.08.33	795 000	EUR	1 087 662	1 154 241	0,03
Slovakia 4.35% 10 - 14.10.25	1 499 000	EUR	1 856 345	1 867 836	0,05
Slovakia 4.50% 06 - 05.10.26	219 080	EUR	288 254	280 513	0,01
			21 674 312	22 583 955	0,62
Slovénie					
Slovenia 0.20% 20 - 31.03.23	987 000	EUR	991 978	998 953	0,03
Slovenia 0.275% 20 - 14.01.30	894 000	EUR	913 554	894 550	0,02
Slovenia 0.875% 20 - 15.07.30	300 000	EUR	303 379	314 146	0,01
Slovenia 1.00% 18 - 03.06.28	1 185 000	EUR	1 197 992	1 270 807	0,03
Slovenia 1.188% 19 - 14.03.29	887 000	EUR	949 562	962 918	0,03
Slovenia 1.25% 17 - 22.03.27	1 487 000	EUR	1 561 244	1 616 181	0,04
Slovenia 1.50% 15 - 25.03.35	1 184 000	EUR	1 222 457	1 329 798	0,04
Slovenia 1.75% 16 - 11.03.40	1 462 000	EUR	1 565 353	1 703 716	0,05
Slovenia 2.125% 15 - 28.07.25	981 000	EUR	1 070 992	1 093 682	0,03
Slovenia 2.25% 14 - 25.03.22	493 000	EUR	515 692	513 757	0,01
Slovenia 2.25% 16 - 03.03.32	1 101 000	EUR	1 282 949	1 337 024	0,04
Slovenia 3.125% 15 - 08.07.45	690 000	EUR	912 632	1 029 566	0,03
Slovenia 4.625% 09 - 09.09.24	635 000	EUR	749 729	761 701	0,02
Slovenia 5.125% 11 - 30.03.26	809 000	EUR	1 032 992	1 053 156	0,03
			14 270 505	14 879 955	0,41
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 30.04.23	7 301 000	EUR	7 344 304	7 363 553	0,20
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	5 660 000	EUR	5 667 996	5 695 977	0,16
Spain 0.05% 18 - 31.10.21	10 498 000	EUR	10 554 806	10 566 293	0,29

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain 0.25% 19 - 30.07.24	8 120 000	EUR	8 253 828	8 274 880	0,23
Spain 0.35% 18 - 30.07.23	10 670 000	EUR	10 788 672	10 882 680	0,30
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	7 572 000	EUR	7 640 794	7 685 588	0,21
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	3 140 000	EUR	3 182 320	3 187 103	0,09
Spain 0.45% 17 - 31.10.22	9 350 000	EUR	9 472 969	9 533 026	0,26
Spain 0.50% 20 - 30.04.30	9 361 000	EUR	9 469 406	9 451 574	0,26
Spain 0.60% 19 - 31.10.29	10 093 000	EUR	10 371 119	10 327 257	0,29
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	9 423 000	EUR	9 516 257	9 547 572	0,26
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	1 734 000	EUR	1 755 395	1 756 923	0,05
Spain 0.80% 20 - 30.07.27	6 154 000	EUR	6 318 140	6 434 093	0,18
Spain 1.00% 20 - 31.10.50	4 401 000	EUR	3 937 735	4 108 842	0,11
Spain 1.25% 20 - 31.10.30	8 985 000	EUR	9 443 938	9 692 690	0,27
Spain 1.30% 16 - 31.10.26	12 591 000	EUR	13 172 455	13 595 510	0,38
Spain 1.40% 18 - 30.04.28	10 419 000	EUR	10 864 366	11 383 443	0,32
Spain 1.40% 18 - 30.07.28	10 813 000	EUR	11 370 915	11 826 652	0,33
Spain 1.45% 17 - 31.10.27	11 365 000	EUR	11 986 587	12 424 639	0,34
Spain 1.45% 19 - 30.04.29	8 764 000	EUR	9 277 629	9 628 660	0,27
Spain 1.45% 19 - 30.04.29	2 019 000	EUR	2 226 356	2 218 195	0,06
Spain 1.50% 17 - 30.04.27	10 126 000	EUR	10 769 722	11 096 412	0,31
Spain 1.60% 15 - 30.04.25	11 108 000	EUR	11 767 016	12 042 128	0,33
Spain 1.85% 19 - 30.07.35	7 075 000	EUR	7 962 515	8 136 325	0,23
Spain 1.95% 15 - 30.07.30	11 554 000	EUR	12 708 824	13 295 109	0,37
Spain 1.95% 16 - 30.04.26	10 473 000	EUR	11 355 067	11 680 223	0,32
Spain 2.15% 15 - 31.10.25	5 895 000	EUR	6 492 417	6 595 824	0,18
Spain 2.15% 15 - 31.10.25	6 122 000	EUR	6 607 966	6 849 810	0,19
Spain 2.35% 17 - 30.07.33	9 607 000	EUR	10 896 942	11 637 076	0,32
Spain 2.70% 18 - 31.10.48	7 249 000	EUR	9 127 258	9 789 278	0,27
Spain 2.75% 14 - 31.10.24	11 855 000	EUR	13 135 146	13 366 912	0,37
Spain 2.90% 16 - 31.10.46	8 732 000	EUR	10 855 696	12 097 269	0,33
Spain 3.45% 16 - 30.07.66	6 643 000	EUR	9 748 593	10 932 252	0,30
Spain 3.80% 14 - 30.04.24	10 453 000	EUR	11 812 461	12 082 486	0,33
Spain 4.00% 14 - 31.10.64	511 000	EUR	678 220	922 272	0,03
Spain 4.20% 05 - 31.01.37	10 200 000	EUR	14 396 145	15 514 375	0,43
Spain 4.40% 13 - 31.10.23	10 921 000	EUR	12 446 126	12 642 612	0,35
Spain 4.65% 10 - 30.07.25	11 662 000	EUR	14 140 328	14 489 556	0,40
Spain 4.70% 09 - 30.07.41	10 225 000	EUR	16 062 055	17 300 945	0,48
Spain 4.80% 08 - 31.01.24	8 666 000	EUR	10 115 541	10 247 749	0,28
Spain 4.90% 07 - 30.07.40	9 477 000	EUR	15 250 813	16 207 424	0,45
Spain 5.15% 13 - 31.10.28	4 054 000	EUR	5 426 373	5 680 584	0,16
Spain 5.15% 13 - 31.10.28	5 285 000	EUR	7 123 427	7 405 498	0,21
Spain 5.15% 13 - 31.10.44	7 145 000	EUR	12 005 595	13 238 921	0,37
Spain 5.40% 13 - 31.01.23	10 750 000	EUR	12 228 173	12 352 558	0,34
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	11 459 000	EUR	17 617 603	18 403 641	0,51
Spain 5.85% 11 - 31.01.22	11 430 000	EUR	12 516 071	12 571 628	0,35

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain 5.90% 11 - 30.07.26	11 008 000	EUR	14 519 191	14 948 612	0,41
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	12 664 000	EUR	18 076 967	18 783 954	0,52
			488 458 238	505 896 583	14,00
Total - Obligations			3 460 549 197	3 580 590 472	99,09
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			3 460 549 197	3 580 590 472	99,09
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			3 460 549 197	3 580 590 472	99,09
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				3 611 185 301	99,93

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
France					
France OAT Zero Coupon 16 - 25.05.22	26 562 000	EUR	26 876 920	26 873 838	5,99
France OAT Zero Coupon 17 - 25.03.23	33 319 000	EUR	33 821 388	33 887 256	7,56
France OAT Zero Coupon 19 - 25.02.22	24 258 000	EUR	24 494 372	24 503 804	5,46
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.23	8 934 000	EUR	9 082 975	9 075 559	2,02
			94 275 655	94 340 457	21,03
Allemagne					
Bundesobligation Zero Coupon 16 - 10.08.21	17 779 000	EUR	17 930 813	17 926 269	3,99
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 04.08.22	16 958 000	EUR	17 167 695	17 165 015	3,83
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 10.07.22	16 429 000	EUR	16 699 172	16 692 649	3,72
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 14.04.23	15 400 000	EUR	15 743 270	15 713 356	3,50
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 06.11.21	11 566 000	EUR	11 648 269	11 637 304	2,59
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 09.10.21	10 853 000	EUR	10 950 671	10 937 491	2,44
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 12.10.21	13 132 000	EUR	13 266 653	13 262 776	2,96
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 03.11.22	11 876 000	EUR	12 033 317	12 011 742	2,68
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 06.10.22	4 207 000	EUR	4 261 603	4 264 196	0,95
			119 701 463	119 610 798	26,66
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.05% 19 - 15.01.23	12 884 000	EUR	12 844 725	12 842 543	2,86
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 16 - 11.01.21	13 262 000	EUR	13 227 314	13 338 124	2,97
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.45% 16 - 06.01.21	13 060 000	EUR	13 063 648	13 127 608	2,93
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.90% 17 - 08.01.22	15 276 000	EUR	15 477 914	15 532 102	3,46
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 18 - 03.01.23	13 810 000	EUR	13 949 444	14 080 503	3,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	10 145 000	EUR	10 281 759	10 335 890	2,30
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	1 075 000	EUR	1 093 019	1 095 228	0,25
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.20% 17 - 04.01.22	13 743 000	EUR	13 895 387	14 012 397	3,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.30% 18 - 15.10.21	13 044 000	EUR	13 330 787	13 446 260	3,00
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 19 - 29.06.21	12 482 000	EUR	12 455 356	12 490 881	2,79
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 19 - 29.11.21	15 355 000	EUR	15 296 986	15 351 000	3,42
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 20 - 30.05.22	3 283 000	EUR	3 253 781	3 272 227	0,73
			138 170 120	138 924 763	30,97
Pays-Bas					
Netherlands Zero Coupon 16 - 15.01.22	12 859 600	EUR	12 980 081	12 982 526	2,89
			12 980 081	12 982 526	2,89
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 30.04.23	12 335 000	EUR	12 424 425	12 440 683	2,77
Spain 0.05% 18 - 31.10.21	17 486 000	EUR	17 572 227	17 599 752	3,92
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	17 429 000	EUR	17 660 791	17 690 454	3,94
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	131 000	EUR	132 988	132 965	0,03
Spain 0.45% 17 - 31.10.22	15 604 000	EUR	15 873 547	15 909 448	3,55

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	16 229 000	EUR	16 412 078	16 443 547	3,67
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	2 036 000	EUR	2 061 084	2 062 916	0,46
			82 137 140	82 279 765	18,34
Total - Obligations			447 264 459	448 138 309	99,89
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			447 264 459	448 138 309	99,89
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			447 264 459	448 138 309	99,89
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				448 604 147	99,99

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
France					
France OAT Zero Coupon 18 - 25.03.24	26 250 000	EUR	26 635 512	26 826 290	10,38
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	26 763 000	EUR	27 213 824	27 437 310	10,61
			53 849 336	54 263 600	20,99
Allemagne					
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 13.10.23	13 352 000	EUR	13 572 484	13 674 327	5,29
Bundesobligation Zero Coupon 19 - 04.05.24	16 660 000	EUR	17 032 000	17 116 900	6,62
Bundesobligation Zero Coupon 19 - 18.10.24	16 261 000	EUR	16 704 533	16 765 850	6,49
Bundesobligation Zero Coupon 20 - 04.11.25	11 385 000	EUR	11 797 038	11 775 506	4,56
			59 106 055	59 332 583	22,96
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 19 - 02.01.25	14 082 000	EUR	13 861 165	13 926 606	5,39
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.60% 20 - 15.06.23	10 087 000	EUR	10 056 079	10 191 332	3,94
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.65% 16 - 15.10.23	11 709 000	EUR	11 401 436	11 845 844	4,59
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 17 - 15.11.24	11 544 000	EUR	11 925 694	11 991 802	4,64
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 18 - 15.05.25	10 935 000	EUR	11 182 578	11 346 600	4,39
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.75% 19 - 07.01.24	12 228 000	EUR	12 743 935	12 827 439	4,96
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.75% 19 - 07.01.24	308 000	EUR	325 448	323 099	0,13
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.85% 17 - 15.05.24	11 074 000	EUR	11 307 306	11 662 930	4,51
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 18 - 10.01.23	12 597 000	EUR	13 041 262	13 466 256	5,21
			95 844 903	97 581 908	37,76
Pays-Bas					
Netherlands Zero Coupon 17 - 15.01.24	11 020 000	EUR	11 187 828	11 271 531	4,36
			11 187 828	11 271 531	4,36
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	8 355 000	EUR	8 363 214	8 408 107	3,25
Spain 0.25% 19 - 30.07.24	11 526 000	EUR	11 724 258	11 745 846	4,55
Spain 0.35% 18 - 30.07.23	15 185 000	EUR	15 311 980	15 487 675	5,99
			35 399 452	35 641 628	13,79
Total - Obligations			255 387 574	258 091 250	99,86
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			255 387 574	258 091 250	99,86
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			255 387 574	258 091 250	99,86
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				258 456 420	100,00

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
France					
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	5 427 000	EUR	5 537 543	5 566 007	1,63
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	22 037 000	EUR	22 815 698	22 996 334	6,74
France OAT 0.50% 16 - 25.05.26	21 342 000	EUR	22 307 640	22 576 460	6,62
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	19 749 000	EUR	20 956 671	21 370 932	6,26
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	1 354 000	EUR	1 443 349	1 465 200	0,43
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	20 274 000	EUR	22 062 437	22 227 520	6,51
			95 123 338	96 202 453	28,19
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	17 630 000	EUR	18 482 507	18 387 429	5,39
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	18 227 000	EUR	19 437 895	19 367 008	5,67
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	18 227 000	EUR	19 207 110	19 481 838	5,71
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	16 435 000	EUR	17 646 670	17 904 124	5,24
			74 774 182	75 140 399	22,01
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.85% 19 - 15.01.27	9 815 000	EUR	9 731 545	9 776 329	2,86
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.25% 16 - 12.01.26	11 290 000	EUR	11 496 243	11 564 034	3,39
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.50% 15 - 06.01.25	11 415 000	EUR	11 403 520	11 879 536	3,48
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.50% 15 - 06.01.25	269 000	EUR	270 106	279 947	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.60% 16 - 06.01.26	11 698 000	EUR	11 937 138	12 238 696	3,59
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.85% 20 - 07.01.25	5 931 000	EUR	6 097 851	6 260 615	1,83
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 15 - 12.01.25	11 610 000	EUR	11 887 367	12 392 989	3,63
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.10% 19 - 15.07.26	10 031 000	EUR	10 691 523	10 766 713	3,16
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.50% 18 - 15.11.25	9 878 000	EUR	10 308 182	10 791 761	3,16
			83 823 475	85 950 620	25,18
Pays-Bas					
Netherlands Zero Coupon 20 - 15.01.27	2 918 000	EUR	3 000 252	3 014 050	0,88
Netherlands 0.25% 15 - 15.07.25	8 044 000	EUR	8 238 190	8 391 983	2,46
Netherlands 0.25% 15 - 15.07.25	937 000	EUR	965 177	977 535	0,29
Netherlands 0.50% 16 - 15.07.26	10 043 000	EUR	10 673 765	10 690 874	3,13
Netherlands 0.50% 16 - 15.07.26	26 000	EUR	27 514	27 677	0,01
			22 904 898	23 102 119	6,77
Espagne					
Spain 1.30% 16 - 31.10.26	15 008 000	EUR	16 067 026	16 205 338	4,75
Spain 20 - 30.04.27	12 146 000		13 233 647	13 309 996	3,90
Spain 1.95% 16 - 30.04.26	12 841 000	EUR	14 170 338	14 321 182	4,20
Spain 2.15% 15 - 31.10.25	12 959 000	EUR	14 125 909	14 499 623	4,25
Spain 2.15% 15 - 31.10.25	992 000	EUR	1 085 080	1 109 934	0,32
			58 682 000	59 446 073	17,42
Total - Obligations			335 307 893	339 841 664	99,57
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			335 307 893	339 841 664	99,57
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			335 307 893	339 841 664	99,57
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				340 942 772	99,89

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
France					
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	5 685 000	EUR	5 757 195	5 791 988	6,27
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	4 654 000	EUR	4 880 363	4 965 563	5,37
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	5 211 000	EUR	5 453 661	5 655 226	6,12
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	313 000	EUR	330 875	339 683	0,37
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	5 067 000	EUR	5 293 734	5 510 596	5,96
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	553 000	EUR	572 106	601 413	0,65
			22 287 934	22 864 469	24,74
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	3 714 000	EUR	3 896 365	3 900 391	4,22
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	3 519 000	EUR	3 709 356	3 693 397	3,99
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	533 000	EUR	555 233	557 636	0,60
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	3 566 000	EUR	3 682 893	3 818 277	4,13
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	3 705 000	EUR	3 875 960	3 974 217	4,30
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	4 108 000	EUR	4 307 122	4 452 302	4,82
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	3 565 780	EUR	3 730 253	3 879 248	4,20
			23 757 182	24 275 468	26,26
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 19 - 04.01.30	3 132 000	EUR	3 028 642	3 169 647	3,43
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 18 - 02.01.28	3 227 000	EUR	3 280 838	3 456 585	3,74
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.05% 17 - 08.01.27	2 684 000	EUR	2 751 704	2 880 825	3,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.20% 17 - 06.01.27	2 388 000	EUR	2 464 084	2 587 216	2,80
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.80% 18 - 12.01.28	2 685 000	EUR	2 838 835	3 051 814	3,30
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.00% 19 - 08.01.29	2 841 000	EUR	3 305 457	3 291 379	3,56
			17 669 560	18 437 466	19,95
Pays-Bas					
Netherlands 0.25% 19 - 15.07.29	51 000	EUR	53 630	53 950	0,06
Netherlands 0.25% 19 - 15.07.29	1 657 000	EUR	1 744 520	1 752 855	1,90
Netherlands 0.75% 17 - 15.07.27	2 151 000	EUR	2 263 316	2 340 822	2,53
Netherlands 0.75% 18 - 15.07.28	1 731 000	EUR	1 824 195	1 899 487	2,05
			5 885 661	6 047 114	6,54
Espagne					
Spain 0.50% 20 - 30.04.30	2 560 000	EUR	2 564 029	2 584 770	2,80
Spain 0.60% 19 - 31.10.29	2 882 000	EUR	2 931 937	2 948 891	3,19
Spain 0.80% 20 - 30.07.27	1 689 000	EUR	1 735 355	1 765 873	1,91
Spain 1.40% 18 - 30.04.28	2 943 000	EUR	3 061 597	3 215 421	3,48
Spain 1.40% 18 - 30.07.28	2 959 000	EUR	3 082 642	3 236 388	3,50
Spain 1.45% 17 - 31.10.27	3 108 000	EUR	3 248 154	3 397 780	3,67
Spain 1.45% 19 - 30.04.29	2 860 000	EUR	3 079 991	3 142 169	3,40

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain 1.45% 19 - 30.04.29	120 000	EUR	132 813	131 839	0,14
Spain - 31.10.25	—		—	—	0,00
			19 836 518	20 423 131	22,09
Total - Obligations			89 436 855	92 047 648	99,58
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			89 436 855	92 047 648	99,58
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			89 436 855	92 047 648	99,58
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				92 350 918	99,91

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
France					
France OAT 1.25% 16 - 25.05.36	606 000	EUR	652 294	708 889	2,26
France OAT 1.25% 16 - 25.05.36	305 000	EUR	350 884	356 784	1,14
France OAT 1.50% 19 - 25.05.50	735 000	EUR	902 679	925 639	2,96
France OAT 1.75% 17 - 25.06.39	697 000	EUR	841 125	887 832	2,84
France OAT 2.00% 17 - 25.05.48	728 300	EUR	915 105	1 009 096	3,22
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	712 000	EUR	1 090 427	1 179 631	3,77
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	731 500	EUR	1 156 085	1 226 217	3,92
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	997 000	EUR	1 721 190	1 833 182	5,85
			7 629 789	8 127 270	25,96
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	620 000	EUR	794 207	845 999	2,70
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 07.04.44	786 000	EUR	1 195 075	1 287 099	4,11
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	844 500	EUR	1 320 619	1 418 126	4,53
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 07.04.42	538 000	EUR	905 822	949 208	3,03
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 01.04.37	754 000	EUR	1 251 610	1 298 936	4,15
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 07.04.39	510 000	EUR	917 514	952 478	3,05
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 07.04.40	179 000	EUR	351 235	360 285	1,15
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 07.04.40	386 000	EUR	742 556	776 927	2,48
			7 478 638	7 889 058	25,20
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 20 - 03.01.36	293 000	EUR	284 770	284 499	0,91
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.25% 16 - 09.01.36	410 000	EUR	414 234	441 790	1,41
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.70% 16 - 03.01.47	478 000	EUR	498 426	531 561	1,70
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.95% 18 - 09.01.38	413 000	EUR	447 607	482 428	1,54
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.10% 19 - 03.01.40	301 000	EUR	344 002	358 363	1,15
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.25% 15 - 09.01.46	453 000	EUR	511 670	552 263	1,76
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	313 000	EUR	346 099	395 471	1,26
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	139 000	EUR	183 197	175 624	0,56
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.85% 19 - 09.01.49	365 000	EUR	513 976	493 599	1,58
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.00% 05 - 02.01.37	769 000	EUR	951 612	1 010 208	3,23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 13 - 09.01.44	497 000	EUR	683 956	744 782	2,38
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 07 - 08.01.39	621 000	EUR	861 022	928 155	2,96
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 09 - 09.01.40	611 000	EUR	847 409	917 526	2,93
			6 887 980	7 316 269	23,37
Pays-Bas					
Netherlands 0.50% 19 - 15.01.40	203 000	EUR	215 347	224 640	0,72
Netherlands 2.75% 14 - 15.01.47	458 000	EUR	736 152	792 170	2,53
Netherlands 3.75% 10 - 15.01.42	443 000	EUR	759 499	808 141	2,58
Netherlands 4.00% 05 - 15.01.37	431 000	EUR	695 347	728 527	2,32
			2 406 345	2 553 478	8,15
Espagne					
Spain 1.85% 19 - 30.07.35	378 000	EUR	426 321	434 704	1,39
Spain 2.70% 18 - 31.10.48	403 000	EUR	511 989	544 224	1,74
Spain 2.90% 16 - 31.10.46	477 000	EUR	612 087	660 833	2,11
Spain 4.20% 05 - 31.01.37	563 000	EUR	816 016	856 333	2,73
Spain 4.70% 09 - 30.07.41	562 000	EUR	899 462	950 918	3,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain 4.90% 07 - 30.07.40	519 000	EUR	842 661	887 586	2,83
Spain 5.15% 13 - 31.10.44	393 000	EUR	681 500	728 187	2,33
			4 790 036	5 062 785	16,17
Total - Obligations			29 192 788	30 948 860	98,85
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			29 192 788	30 948 860	98,85
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			29 192 788	30 948 860	98,85
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				31 296 617	99,96

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
France					
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	630 000	EUR	667 211	657 552	1,91
France OAT 1.50% 19 - 25.05.50	1 950 000	EUR	2 301 448	2 455 777	7,15
France OAT 1.75% 16 - 25.05.66	963 400	EUR	1 173 295	1 375 730	4,01
France OAT 2.00% 17 - 25.05.48	1 940 000	EUR	2 371 013	2 687 966	7,83
France OAT 4.00% 05 - 25.04.55	1 227 500	EUR	2 259 799	2 536 285	7,39
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	1 143 600	EUR	2 208 037	2 494 596	7,26
			10 980 803	12 207 906	35,55
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	601 000	EUR	604 289	603 725	1,76
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	1 654 000	EUR	2 059 700	2 256 907	6,57
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	2 249 800	EUR	3 416 091	3 777 976	11,00
			6 080 080	6 638 608	19,33
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 20 - 09.01.50	961 000	EUR	1 010 324	1 010 501	2,94
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.70% 16 - 03.01.47	1 278 000	EUR	1 336 584	1 421 202	4,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.80% 16 - 03.01.67	717 000	EUR	736 093	798 335	2,33
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.25% 15 - 09.01.46	1 202 000	EUR	1 385 365	1 465 385	4,27
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	1 100 000	EUR	1 259 150	1 389 834	4,05
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	110 000	EUR	145 787	138 983	0,40
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.85% 19 - 09.01.49	985 000	EUR	1 223 263	1 332 040	3,88
			7 096 566	7 556 280	22,01
Pays-Bas					
Netherlands 2.75% 14 - 15.01.47	1 220 855	EUR	1 924 126	2 111 626	6,15
			1 924 126	2 111 626	6,15
Espagne					
Spain 1.00% 20 - 31.10.50	643 000	EUR	577 115	600 315	1,75
Spain 2.70% 18 - 31.10.48	1 068 000	EUR	1 335 708	1 442 261	4,20
Spain 2.90% 16 - 31.10.46	1 270 000	EUR	1 576 135	1 759 452	5,12
Spain 3.45% 16 - 30.07.66	980 000	EUR	1 446 890	1 612 766	4,70
Spain 4.00% 14 - 31.10.64	53 000	EUR	64 253	95 656	0,28
Spain 4.00% 14 - 31.10.64	32 000	EUR	49 892	57 755	0,17
			5 049 993	5 568 205	16,22
Total - Obligations			31 131 568	34 082 625	99,26
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			31 131 568	34 082 625	99,26
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			31 131 568	34 082 625	99,26
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				34 334 900	99,99

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Australie					
Australia 0.75% 17 - 21.11.27	2 335 000	AUD	1 546 779	1 609 336	0,11
Australia 1.00% 18 - 21.02.50	1 838 000	AUD	1 219 253	1 406 617	0,10
Australia 1.25% 12 - 21.02.22	2 966 000	AUD	2 246 201	2 158 491	0,15
Australia 1.25% 15 - 21.08.40	1 644 000	AUD	1 221 863	1 330 599	0,09
Australia 2.00% 13 - 21.08.35	1 855 000	AUD	1 591 665	1 676 413	0,12
Australia 2.50% 10 - 20.09.30	2 497 000	AUD	2 335 665	2 382 918	0,17
Australia 3.00% 09 - 20.09.25	3 529 000	AUD	3 288 194	3 161 930	0,22
			13 449 620	13 726 304	0,96
Canada					
Canada 1.25% 13 - 12.01.47	3 942 323	CAD	3 192 972	3 511 837	0,25
Canada 4.00% 99 - 12.01.31	3 959 810	CAD	3 720 998	3 887 096	0,27
Canada 4.25% 91 - 12.01.21	3 367 221	CAD	2 405 758	2 325 465	0,16
Canada 4.25% 95 - 12.01.26	4 002 716	CAD	3 372 866	3 403 170	0,24
			12 692 594	13 127 568	0,92
Danemark					
Denmark Inflation Linked Bond 0.10% 12 - 15.11.23	13 103 646	DKK	1 831 913	1 839 867	0,13
Denmark Inflation Linked Bond 0.10% 18 - 15.11.30	7 264 560	DKK	1 067 847	1 113 042	0,08
			2 899 760	2 952 909	0,21
France					
France OAT 0.10% 12 - 25.07.21	3 634 553	EUR	3 684 703	3 662 648	0,26
France OAT 0.10% 15 - 03.01.25	5 486 639	EUR	5 742 086	5 725 966	0,40
France OAT 0.10% 16 - 25.07.47	4 894 067	EUR	5 396 302	6 043 879	0,42
France OAT 0.10% 17 - 03.01.28	5 822 660	EUR	6 231 934	6 254 294	0,44
France OAT 0.10% 18 - 25.07.36	3 182 560	EUR	3 544 513	3 670 701	0,26
France OAT 0.10% 19 - 03.01.29	3 991 109	EUR	4 379 569	4 364 916	0,31
France OAT 0.25% 13 - 25.07.24	9 114 620	EUR	9 640 235	9 578 737	0,67
France OAT 0.70% 14 - 25.07.30	7 301 706	EUR	8 274 969	8 565 047	0,60
France OAT 1.10% 10 - 25.07.22	10 633 614	EUR	11 174 416	11 054 812	0,78
France OAT 1.80% 07 - 25.07.40	6 746 143	EUR	9 723 135	10 431 695	0,73
France OAT 1.85% 11 - 25.07.27	11 208 536	EUR	13 352 623	13 535 428	0,95
France OAT 2.10% 08 - 25.07.23	9 655 536	EUR	10 611 098	10 525 018	0,74
France OAT 3.15% 02 - 25.07.32	6 417 591	EUR	9 443 354	9 723 357	0,68
France OAT 3.40% 99 - 25.07.29	5 675 560	EUR	7 835 035	8 006 570	0,56
			109 033 972	111 143 068	7,80
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0.10% 12 - 15.04.23	8 256 542	EUR	8 555 113	8 416 471	0,59
Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0.10% 15 - 15.04.26	8 132 378	EUR	8 742 918	8 700 913	0,61
Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0.10% 15 - 15.04.46	4 672 464	EUR	5 813 512	6 430 011	0,45
Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0.50% 14 - 15.04.30	8 374 855	EUR	9 638 280	9 822 699	0,69
			32 749 823	33 370 094	2,34
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.10% 16 - 15.05.22	5 421 097	EUR	5 422 263	5 378 270	0,38
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.10% 18 - 15.05.23	4 225 327	EUR	4 210 004	4 187 848	0,29
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.40% 19 - 15.05.30	3 396 301	EUR	3 262 893	3 271 114	0,23

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.25% 15 - 15.09.32	7 176 374	EUR	7 191 301	7 461 419	0,52
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.30% 17 - 15.05.28	7 829 017	EUR	7 922 907	8 147 110	0,57
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.10% 10 - 15.09.21	8 825 118	EUR	9 066 625	9 028 272	0,63
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.35% 04 - 15.09.35	7 667 048	EUR	8 860 930	9 174 619	0,65
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.35% 14 - 15.09.24	6 560 212	EUR	7 047 991	7 092 179	0,50
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.55% 09 - 15.09.41	6 433 976	EUR	7 521 815	8 082 296	0,57
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.60% 07 - 15.09.23	9 950 910	EUR	10 683 160	10 706 384	0,75
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.10% 11 - 15.09.26	6 526 912	EUR	7 415 915	7 547 656	0,53
			78 605 804	80 077 167	5,62
Nouvelle-Zélande					
New Zealand Government Inflation Linked Bond 2.00% 12 - 20.09.25	2 128 000	NZD	1 435 713	1 480 050	0,10
New Zealand Government Inflation Linked Bond 2.50% 14 - 20.09.35	1 994 000	NZD	1 515 298	1 644 494	0,12
New Zealand Government Inflation Linked Bond FRN 13 - 20.09.30	2 016 000	NZD	1 515 976	1 631 000	0,12
			4 466 987	4 755 544	0,34
Espagne					
Spain Inflation Linked Bond 0.15% 18 - 30.11.23	1 822 481	EUR	1 889 308	1 872 781	0,13
Spain Inflation Linked Bond 0.30% 16 - 30.11.21	3 155 598	EUR	3 213 523	3 186 018	0,23
Spain Inflation Linked Bond 0.65% 17 - 30.11.27	5 145 580	EUR	5 462 111	5 593 966	0,39
Spain Inflation Linked Bond 0.70% 18 - 30.11.33	3 526 551	EUR	3 831 231	3 974 600	0,28
Spain Inflation Linked Bond 1.00% 15 - 30.11.30	5 630 820	EUR	6 161 994	6 443 966	0,45
Spain Inflation Linked Bond 1.80% 14 - 30.11.24	6 427 427	EUR	7 043 002	7 128 916	0,50
			27 601 169	28 200 247	1,98
Suède					
Sweden Inflation Linked Bond 0.125% 15 - 06.01.32	9 565 000	SEK	1 151 384	1 173 349	0,08
Sweden Inflation Linked Bond 0.125% 16 - 06.01.26	10 360 000	SEK	1 209 871	1 160 184	0,08
Sweden Inflation Linked Bond 0.125% 17 - 12.01.27	7 495 000	SEK	861 640	849 011	0,06
Sweden Inflation Linked Bond 0.125% 20 - 06.01.30	4 000 000	SEK	442 932	445 585	0,03
Sweden Inflation Linked Bond 0.25% 11 - 06.01.22	11 500 000	SEK	1 293 854	1 213 424	0,09
Sweden Inflation Linked Bond 1.00% 14 - 06.01.25	13 375 000	SEK	1 639 565	1 531 441	0,11
Sweden Inflation Linked Bond 3.50% 99 - 12.01.28	11 835 000	SEK	2 328 060	2 140 276	0,15
			8 927 306	8 513 270	0,60
Royaume-Uni					
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 11 - 22.03.29	8 288 103	GBP	11 433 243	11 814 902	0,83
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 12 - 22.03.44	8 908 276	GBP	15 882 672	17 798 792	1,25
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 12 - 22.03.24	8 606 250	GBP	10 744 762	10 473 786	0,74
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 13 - 22.03.68	6 938 060	GBP	19 018 403	23 138 082	1,62
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 14 - 22.03.58	5 863 662	GBP	13 319 708	15 579 816	1,09
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 15 - 22.03.46	7 159 315	GBP	13 136 937	14 863 797	1,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 15 - 22.03.26	7 142 206	GBP	9 279 346	9 274 507	0,65
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 16 - 22.11.65	3 809 483	GBP	9 909 517	11 922 583	0,84
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 16 - 22.11.36	6 410 593	GBP	10 309 971	11 096 499	0,78
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 16 - 22.11.56	3 113 704	GBP	6 801 435	8 083 960	0,57
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 17 - 08.10.48	5 463 052	GBP	10 603 293	11 915 580	0,84
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 18 - 08.10.28	6 862 195	GBP	9 685 709	9 620 226	0,68
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 18 - 08.10.41	5 131 160	GBP	9 096 087	9 770 693	0,69
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.25% 12 - 22.03.52	7 024 671	GBP	14 851 572	16 922 898	1,19
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.375% 11 - 22.03.62	7 268 420	GBP	18 743 619	22 232 625	1,56
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.50% 09 - 22.03.50	7 878 513	GBP	16 705 440	19 128 072	1,34
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.625% 09 - 22.11.42	8 152 170	GBP	15 641 699	17 335 234	1,22
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.625% 10 - 22.03.40	8 906 031	GBP	16 213 678	17 742 182	1,25
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.75% 07 - 22.11.47	7 715 597	GBP	16 605 922	18 722 006	1,31
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.75% 11 - 22.03.34	8 595 356	GBP	14 074 316	15 007 128	1,05
United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.125% 07 - 22.11.37	8 870 797	GBP	16 493 063	17 996 866	1,26
United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.25% 05 - 22.11.55	7 268 088	GBP	20 242 650	23 423 381	1,64
United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.25% 06 - 22.11.27	9 993 495	GBP	14 587 608	14 737 086	1,04
United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.25% 08 - 22.11.32	8 483 803	GBP	14 135 817	15 056 891	1,06
United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.875% 07 - 22.11.22	10 431 326	GBP	13 172 919	12 734 833	0,89
United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.00% 02 - 26.01.35	4 289 443	GBP	13 736 690	14 455 469	1,02
United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.50% 86 - 17.07.24	3 175 708	GBP	13 414 845	12 586 931	0,88
United Kingdom Gilt Inflation Linked 4.125% 92 - 22.07.30	2 251 367	GBP	9 689 755	9 603 821	0,67
			377 530 676	413 038 646	29,00
États-Unis					
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 12 - 15.01.22	22 145 040	USD	19 790 538	19 993 591	1,40

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 12 - 15.07.22	21 201 645	USD	18 858 766	19 327 709	1,36
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 13 - 15.01.23	21 637 475	USD	19 300 075	19 742 043	1,39
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 14 - 15.07.24	20 866 850	USD	18 531 838	19 414 248	1,36
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 16 - 15.07.26	18 585 073	USD	16 475 906	17 585 554	1,23
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 17 - 15.04.22	22 140 388	USD	19 392 207	20 008 640	1,40
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 19 - 15.10.24	16 435 436	USD	14 845 755	15 335 085	1,08
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 20 - 15.01.30	19 178 467	USD	18 059 824	18 469 915	1,30
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.125% 20 - 15.04.25	8 677 247	USD	8 125 010	8 107 667	0,57
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.25% 15 - 15.01.25	20 822 330	USD	18 584 365	19 517 030	1,37
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.25% 19 - 15.07.29	18 814 856	USD	17 336 314	18 344 323	1,29
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.25% 20 - 15.02.50	3 743 542	USD	3 590 510	3 746 056	0,26
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.375% 13 - 15.07.23	21 283 476	USD	18 937 369	19 740 225	1,38
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.375% 15 - 15.07.25	20 925 631	USD	18 674 499	19 907 707	1,40
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.375% 17 - 15.01.27	19 086 515	USD	16 968 578	18 329 949	1,29
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.375% 17 - 15.07.27	18 047 660	USD	15 778 321	17 480 931	1,23
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.50% 18 - 15.01.28	18 933 690	USD	16 356 437	18 495 723	1,30
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.625% 11 - 15.07.21	18 362 481	USD	16 324 678	16 638 511	1,17
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.625% 13 - 15.02.43	12 035 047	USD	10 528 646	12 626 314	0,89
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.625% 14 - 15.01.24	21 129 841	USD	19 026 803	19 823 211	1,39
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.625% 16 - 15.01.26	21 281 154	USD	19 152 523	20 526 773	1,44
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.625% 18 - 15.04.23	22 777 574	USD	20 012 527	21 094 752	1,48
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.75% 12 - 15.02.42	12 410 577	USD	11 144 250	13 241 803	0,93
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.75% 15 - 15.02.45	11 649 027	USD	10 383 749	12 699 410	0,89
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.75% 18 - 15.07.28	17 354 327	USD	15 585 896	17 435 088	1,22

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Inflation Indexed Bond 0.875% 17 - 15.02.47	9 396 574	USD	8 650 949	10 681 454	0,75
United States Treasury Inflation Indexed Bond 1.00% 16 - 15.02.46	10 346 884	USD	9 918 414	11 946 584	0,84
United States Treasury Inflation Indexed Bond 1.00% 18 - 15.02.48	9 069 525	USD	8 389 818	10 686 708	0,75
United States Treasury Inflation Indexed Bond 1.125% 11 - 15.01.21	0	USD	(9)	—	0,00
United States Treasury Inflation Indexed Bond 1.375% 14 - 15.02.44	11 960 364	USD	12 211 126	14 547 054	1,02
United States Treasury Inflation Indexed Bond 1.75% 08 - 15.01.28	9 215 345	USD	9 032 317	9 798 323	0,69
United States Treasury Inflation Indexed Bond 2.00% 06 - 15.01.26	12 123 234	USD	11 794 681	12 544 880	0,88
United States Treasury Inflation Indexed Bond 2.125% 10 - 15.02.40	8 419 926	USD	9 405 991	11 061 509	0,78
United States Treasury Inflation Indexed Bond 2.125% 11 - 15.02.41	13 120 801	USD	15 074 156	17 459 584	1,22
United States Treasury Inflation Indexed Bond 2.375% 04 - 15.01.25	17 772 494	USD	17 274 472	18 223 087	1,28
United States Treasury Inflation Indexed Bond 2.375% 07 - 15.01.27	9 871 310	USD	9 851 425	10 677 981	0,75
United States Treasury Inflation Indexed Bond 2.50% 09 - 15.01.29	7 860 251	USD	8 237 167	8 979 022	0,63
United States Treasury Inflation Indexed Bond 3.375% 01 - 15.04.32	3 429 162	USD	4 044 955	4 547 723	0,32
United States Treasury Inflation Indexed Bond 3.625% 98 - 15.04.28	12 454 020	USD	13 768 326	14 936 823	1,05
United States Treasury Inflation Indexed Bond 3.875% 99 - 15.04.29	14 338 528	USD	16 352 897	18 062 446	1,27
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.50% 19 - 15.04.24	15 330 802	USD	13 856 716	14 354 593	1,01
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.875% 19 - 15.01.29	17 314 290	USD	16 219 005	17 591 830	1,23
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.00% 19 - 15.02.49	7 341 740	USD	7 357 176	8 732 177	0,61
			593 204 966	642 464 036	45,10
Total - Obligations			1 261 162 677	1 351 368 853	94,87
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 261 162 677	1 351 368 853	94,87

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Canada					
Canada 0.50% 17 - 12.01.50	3 246 853	CAD	2 230 167	2 505 145	0,17
Canada 1.50% 10 - 12.01.44	4 174 032	CAD	3 459 785	3 747 332	0,26
Canada 2.00% 07 - 12.01.41	3 646 525	CAD	3 191 064	3 418 755	0,24
Canada 3.00% 03 - 12.01.36	3 567 474	CAD	3 349 959	3 514 278	0,25
			12 230 975	13 185 510	0,92
Japon					
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 13 - 09.10.23	282 240 000	JPY	2 322 484	2 330 178	0,16
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 14 - 03.10.24	383 928 300	JPY	3 185 747	3 175 611	0,22
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 14 - 09.10.24	505 774 500	JPY	4 183 064	4 167 459	0,29
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 15 - 03.10.25	961 166 701	JPY	8 011 679	7 899 950	0,56
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 16 - 03.10.26	728 427 751	JPY	6 098 429	5 989 023	0,42
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 17 - 03.10.27	742 064 928	JPY	6 089 543	6 104 820	0,43
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 18 - 03.10.28	740 985 641	JPY	6 135 102	6 103 402	0,43
Japanese Government CPI Linked Bond 0.20% 20 - 03.10.30	94 535 450	JPY	801 786	794 748	0,06
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 19 - 03.10.29	742 591 584	JPY	6 412 741	6 130 112	0,43
			43 240 575	42 695 303	3,00
Nouvelle-Zélande					
New Zealand Government Inflation Linked Bond 2.50% 17 - 20.09.40	1 952 000	NZD	1 447 815	1 675 340	0,12
			1 447 815	1 675 340	0,12
Total - Obligations			56 919 365	57 556 153	4,04
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			56 919 365	57 556 153	4,04
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 318 082 042	1 408 925 006	98,91
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 412 827 861	99,19

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
France					
France OAT 0.10% 12 - 25.07.21	5 959 139	EUR	6 050 385	6 005 203	1,50
France OAT 0.10% 15 - 03.01.25	8 218 247	EUR	8 619 925	8 576 727	2,15
France OAT 0.10% 15 - 03.01.25	391 865	EUR	415 674	408 958	0,10
France OAT 0.10% 16 - 25.07.47	7 370 444	EUR	8 089 199	9 102 056	2,28
France OAT 0.10% 16 - 25.07.47	280 446	EUR	337 072	346 334	0,09
France OAT 0.10% 17 - 03.01.28	9 205 248	EUR	9 842 612	9 887 633	2,48
France OAT 0.10% 18 - 25.07.36	5 055 265	EUR	5 650 067	5 830 641	1,46
France OAT 0.10% 19 - 03.01.29	6 301 388	EUR	6 935 669	6 891 576	1,72
France OAT 0.25% 13 - 25.07.24	14 136 421	EUR	14 941 391	14 856 248	3,72
France OAT 0.70% 14 - 25.07.30	10 806 143	EUR	12 260 998	12 675 822	3,17
France OAT 0.70% 14 - 25.07.30	813 784	EUR	952 275	954 584	0,24
France OAT 1.10% 10 - 25.07.22	16 628 248	EUR	17 478 009	17 286 893	4,33
France OAT 1.80% 07 - 25.07.40	10 552 813	EUR	15 202 243	16 318 025	4,09
France OAT 1.85% 11 - 25.07.27	17 549 571	EUR	20 961 032	21 192 862	5,31
France OAT 2.10% 08 - 25.07.23	15 145 747	EUR	16 680 506	16 509 622	4,13
France OAT 3.15% 02 - 25.07.32	10 013 298	EUR	14 641 119	15 171 248	3,80
France OAT 3.40% 99 - 25.07.29	8 791 558	EUR	12 173 909	12 402 339	3,10
			171 232 085	174 416 771	43,67
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0.10% 12 - 15.04.23	13 180 576	EUR	13 688 218	13 435 884	3,37
Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0.10% 15 - 15.04.26	12 866 284	EUR	13 839 644	13 765 766	3,45
Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0.10% 15 - 15.04.46	7 286 023	EUR	9 108 023	10 026 660	2,51
Bundesrepublik Deutschland Inflation Linked Bond 0.50% 14 - 15.04.30	13 154 358	EUR	15 205 817	15 428 483	3,86
			51 841 702	52 656 793	13,19
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.10% 16 - 15.05.22	8 034 934	EUR	8 058 754	7 971 458	2,00
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.10% 18 - 15.05.23	6 629 623	EUR	6 620 336	6 570 819	1,64
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.40% 19 - 15.05.30	5 331 391	EUR	5 175 139	5 134 876	1,29
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.25% 15 - 15.09.32	11 299 751	EUR	11 436 003	11 748 577	2,94
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.30% 17 - 15.05.28	12 295 860	EUR	12 558 727	12 795 441	3,20
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.10% 10 - 15.09.21	14 350 330	EUR	14 776 614	14 680 675	3,68
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.35% 04 - 15.09.35	12 038 907	EUR	14 058 183	14 406 117	3,61
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.35% 14 - 15.09.24	10 315 527	EUR	11 116 910	11 152 013	2,79
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.55% 09 - 15.09.41	10 082 705	EUR	11 988 033	12 665 794	3,17
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.60% 07 - 15.09.23	15 584 134	EUR	16 792 575	16 767 281	4,20
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.10% 11 - 15.09.26	10 199 550	EUR	11 639 976	11 794 658	2,95
			124 221 250	125 687 709	31,47
Espagne					
Spain Inflation Linked Bond 0.15% 18 - 30.11.23	2 792 411	EUR	2 897 686	2 869 481	0,72
Spain Inflation Linked Bond 0.30% 16 - 30.11.21	4 754 896	EUR	4 848 799	4 800 734	1,20
Spain Inflation Linked Bond 0.65% 17 - 30.11.27	8 154 135	EUR	8 687 748	8 864 686	2,22
Spain Inflation Linked Bond 0.70% 18 - 30.11.33	5 592 029	EUR	6 070 912	6 302 497	1,58

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain Inflation Linked Bond 1.00% 15 - 30.11.30	8 743 581	EUR	9 640 879	10 006 241	2,50
Spain Inflation Linked Bond 1.80% 14 - 30.11.24	10 226 978	EUR	11 269 663	11 343 151	2,84
			43 415 687	44 186 790	11,06
Total - Obligations			390 710 724	396 948 063	99,39
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			390 710 724	396 948 063	99,39
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			390 710 724	396 948 063	99,39
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				399 434 182	100,01

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Australie					
Ausgrid Finance Pty Ltd. 1.25% 18 - 30.07.25	200 000	EUR	206 417	205 613	0,04
Australia 3.00% 16 - 21.03.47	1 436 000	AUD	959 646	1 109 716	0,20
New South Wales Treasury Corp. 4.00% 14 - 20.05.26	11 000 000	AUD	7 656 435	7 986 108	1,46
Queensland Treasury Corp. 3.50% 17 - 21.08.30	25 000 000	AUD	16 180 010	18 384 262	3,35
			25 002 508	27 685 699	5,05
Autriche					
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	3 000 000	EUR	5 076 856	5 913 087	1,08
			5 076 856	5 913 087	1,08
Belgique					
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.21	12 200 000	EUR	12 251 356	12 248 800	2,24
			12 251 356	12 248 800	2,24
Finlande					
OP Corporate Bank PLC 0.375% 19 - 19.06.24	300 000	EUR	300 703	296 844	0,06
Sampo OYJ 1.50% 14 - 16.09.21	550 000	EUR	560 491	558 990	0,10
			861 194	855 834	0,16
France					
BPCE SA 0.375% 16 - 10.05.23	300 000	EUR	303 247	301 989	0,06
BPCE SA 0.875% 18 - 31.01.24	100 000	EUR	102 096	100 870	0,02
BPCE SA 1.00% 19 - 15.07.24	400 000	EUR	413 974	412 524	0,08
BPCE SA 1.00% 19 - 04.01.25	200 000	EUR	205 600	202 497	0,04
BPCE SA FRN 14 - 07.08.26	500 000	EUR	517 978	507 979	0,09
Credit Agricole SA 2.625% 15 - 17.03.27	534 000	EUR	600 558	574 937	0,10
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.32	54 400 000	EUR	54 081 027	54 053 472	9,86
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.43	18 000 000	EUR	15 838 237	15 823 800	2,89
Veolia Environnement SA 0.314% 16 - 10.04.23	1 100 000	EUR	1 111 665	1 103 528	0,20
Vinci SA 1.625% 19 - 18.01.29	500 000	EUR	562 950	547 162	0,10
Vivendi SA 0.75% 16 - 26.05.21	400 000	EUR	402 858	401 516	0,07
			74 140 190	74 030 274	13,51
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 01.04.21	8 600 000	EUR	8 626 974	8 630 788	1,57
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 01.04.26	8 300 000	EUR	8 479 137	8 591 745	1,57
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 01.04.27	5 200 000	EUR	5 286 154	5 378 724	0,98
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 07 - 07.04.38	3 100 000	EUR	3 044 649	3 178 678	0,58
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	14 500 000	EUR	14 987 051	14 907 885	2,72
Commerzbank AG 1.125% 19 - 22.06.26	400 000	EUR	406 799	391 767	0,07
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.125% 18 - 05.09.33	6 000 000	EUR	6 753 780	6 940 437	1,27
			47 584 544	48 020 024	8,76
Italie					
Enel SpA 5.25% 04 - 20.05.24	600 000	EUR	736 566	716 955	0,13
			736 566	716 955	0,13

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon					
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 17 - 20.12.37	330 200 000	JPY	3 030 619	2 836 447	0,52
			3 030 619	2 836 447	0,52
Jersey					
Glencore Finance Europe Ltd. 1.875% 16 - 13.09.23	1 350 000	EUR	1 420 268	1 364 879	0,25
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 19 - 14.03.34	600 000	EUR	645 408	605 731	0,11
			2 065 676	1 970 610	0,36
Pays-Bas					
Koninklijke DSM NV 0.75% 16 - 28.09.26	300 000	EUR	316 521	311 408	0,05
NN Group NV 0.875% 17 - 13.01.23	600 000	EUR	612 535	605 578	0,11
NN Group NV 1.00% 15 - 18.03.22	200 000	EUR	203 738	202 053	0,04
NN Group NV 1.625% 17 - 06.01.27	100 000	EUR	107 984	105 702	0,02
			1 240 778	1 224 741	0,22
Norvège					
Telenor ASA 2.50% 13 - 22.05.25	500 000	EUR	557 030	555 767	0,10
			557 030	555 767	0,10
Espagne					
Spain 3.45% 16 - 30.07.66	5 200 000	EUR	8 421 712	8 557 536	1,56
			8 421 712	8 557 536	1,56
Royaume-Uni					
Aviva PLC 1.875% 18 - 13.11.27	200 000	EUR	218 872	216 129	0,04
United Kingdom Gilt 1.75% 16 - 09.07.37	119 416 000	GBP	157 063 488	157 598 770	28,75
United Kingdom Gilt 4.25% 10 - 12.07.40	46 456 000	GBP	86 840 510	87 122 713	15,89
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 12 - 22.03.44	17 333 929	GBP	34 452 056	34 501 528	6,29
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 16 - 22.11.36	7 204 976	GBP	12 415 241	12 440 633	2,27
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 17 - 08.10.48	8 984 361	GBP	19 491 809	19 508 904	3,56
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.625% 10 - 22.03.40	11 552 264	GBP	22 898 746	22 946 781	4,19
United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.875% 07 - 22.11.22	14 226 900	GBP	17 450 725	17 364 969	3,17
			350 831 447	351 700 427	64,16
États-Unis					
Citigroup Inc. 1.25% 19 - 04.10.29	265 000	EUR	278 018	274 693	0,05
Pfizer Inc. 1.00% 17 - 03.06.27	750 000	EUR	786 086	786 212	0,14
			1 064 104	1 060 905	0,19
Total - Obligations			532 864 580	537 377 106	98,04
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			532 864 580	537 377 106	98,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
Obligations					
Supranationales					
Inter-American Development Bank 4.25% 14 - 06.11.26	5 000 000	AUD	3 517 329	3 654 478	0,67
			3 517 329	3 654 478	0,67
Total - Obligations			3 517 329	3 654 478	0,67
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			3 517 329	3 654 478	0,67
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			536 381 909	541 031 584	98,71
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				542 505 127	98,97

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.24	2 300 000	EUR	2 296 351	2 348 346	16,47
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.28	500 000	EUR	470 452	510 420	3,58
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.31	350 000	EUR	314 081	352 380	2,47
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.32	200 000	EUR	199 641	199 552	1,40
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.32	300 000	EUR	261 116	298 089	2,09
			3 541 641	3 708 787	26,01
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 01.04.23	1 100 000	EUR	1 108 739	1 118 227	7,84
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.27	1 000 000	EUR	982 609	1 035 580	7,26
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 07.04.28	1 000 000	EUR	1 030 466	1 039 070	7,29
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.32	2 100 000	EUR	2 133 337	2 185 722	15,33
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 07 - 07.04.39	2 400 000	EUR	2 340 455	2 457 840	17,24
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	700 000	EUR	713 942	719 691	5,05
			8 309 548	8 556 130	60,01
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 98 - 11.01.29	300 000	EUR	251 061	264 537	1,86
			251 061	264 537	1,86
Espagne					
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.10.24	200 000	EUR	199 524	200 848	1,41
			199 524	200 848	1,41
États-Unis					
Tennessee Valley Authority 5.35% 98 - 06.07.21	1 000 000	GBP	1 258 885	1 149 252	8,06
			1 258 885	1 149 252	8,06
Total - Obligations			13 560 659	13 879 554	97,35
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			13 560 659	13 879 554	97,35

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 10 - 03.01.25	300 000	EUR	286 744	291 123	2,04
			286 744	291 123	2,04
Total - Obligations			286 744	291 123	2,04
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			286 744	291 123	2,04
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			13 847 403	14 170 677	99,39
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				14 174 601	99,42

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Autriche					
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	1 200 000	EUR	2 079 012	2 365 235	2,08
			2 079 012	2 365 235	2,08
Canada					
Canada 5.75% 98 - 06.01.29	3 600 000	CAD	3 267 150	3 431 005	3,02
National Bank of Canada 1.50% 14 - 25.03.21	1 000 000	EUR	1 020 860	1 013 170	0,89
			4 288 010	4 444 175	3,91
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.24	1 200 000	EUR	1 225 159	1 225 224	1,08
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.32	1 300 000	EUR	1 262 646	1 293 370	1,14
Total Capital International SA 1.375% 14 - 19.03.25	1 000 000	EUR	1 077 050	1 054 070	0,93
			3 564 855	3 572 664	3,15
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 01.04.22	1 100 000	EUR	1 109 311	1 111 253	0,98
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.22	2 300 000	EUR	2 331 542	2 330 245	2,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.25	2 100 000	EUR	2 181 924	2 168 250	1,91
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 07.04.28	3 000 000	EUR	3 091 397	3 117 210	2,75
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 07 - 07.04.35	3 600 000	EUR	3 617 615	3 714 048	3,27
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 10 - 07.04.42	300 000	EUR	299 509	303 831	0,27
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 12 - 07.04.44	1 000 000	EUR	941 803	1 012 800	0,89
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 00 - 01.04.31	22 100 000	EUR	23 035 159	23 064 886	20,32
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	20 600 000	EUR	21 249 074	21 179 478	18,66
			57 857 334	58 002 001	51,10
Luxembourg					
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 0.50% 18 - 08.09.22	300 000	EUR	303 853	297 430	0,26
			303 853	297 430	0,26
Pays-Bas					
ABB Finance BV 0.625% 16 - 05.03.23	550 000	EUR	561 513	556 546	0,49
			561 513	556 546	0,49
Espagne					
Spain 3.45% 16 - 30.07.66	1 000 000	EUR	1 619 560	1 645 680	1,45
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 98 - 31.01.23	2 100 000	EUR	2 109 591	2 114 658	1,86
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 98 - 31.01.28	1 800 000	EUR	1 730 494	1 764 180	1,56
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 01 - 30.07.20	4 700 000	EUR	4 701 599	4 701 457	4,14
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 01 - 30.07.21	1 600 000	EUR	1 604 975	1 607 360	1,42

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 11 - 30.04.21	1 500 000	EUR	1 504 195	1 505 565	1,33
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.10.20	500 000	EUR	500 714	500 740	0,44
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.10.24	3 100 000	EUR	3 092 619	3 113 144	2,74
			16 863 747	16 952 784	14,94
Supranationales					
European Investment Bank 1.00% 16 - 14.04.32	1 500 000	EUR	1 698 732	1 712 295	1,51
European Union 0.75% 16 - 04.04.31	8 400 000	EUR	9 094 268	9 184 266	8,09
			10 793 000	10 896 561	9,60
Suisse					
UBS Group AG 2.125% 16 - 03.04.24	800 000	EUR	866 592	848 335	0,75
			866 592	848 335	0,75
Royaume-Uni					
HSBC Holdings PLC 3.00% 15 - 30.06.25	800 000	EUR	900 664	883 233	0,78
Sky Ltd. 1.50% 14 - 15.09.21	750 000	EUR	765 304	760 965	0,67
Vodafone Group PLC 2.875% 17 - 20.11.37	1 000 000	EUR	1 243 660	1 156 169	1,02
			2 909 628	2 800 367	2,47
États-Unis					
Metropolitan Life Global Funding I 0.875% 15 - 20.01.22	1 000 000	EUR	1 015 447	1 012 836	0,89
Verizon Communications Inc. 1.625% 14 - 03.01.24	200 000	EUR	214 122	210 112	0,19
			1 229 569	1 222 948	1,08
Total - Obligations			101 317 113	101 959 046	89,83
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			101 317 113	101 959 046	89,83

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.23	6 000 000	EUR	5 847 461	5 938 320	5,23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 14 - 15.12.21	2 500 000	EUR	2 484 167	2 505 825	2,21
			8 331 628	8 444 145	7,44
Total - Obligations			8 331 628	8 444 145	7,44
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			8 331 628	8 444 145	7,44
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			109 648 741	110 403 191	97,27
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				110 569 236	97,42

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.32	200 000	EUR	196 926	199 552	0,44
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.42	800 000	EUR	692 539	711 472	1,57
Indigo Group SAS 2.125% 14 - 16.04.25	1 200 000	EUR	1 305 111	1 230 228	2,71
			2 194 576	2 141 252	4,72
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 01.04.26	5 000 000	EUR	5 170 427	5 175 750	11,40
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 05 - 01.04.34	4 700 000	EUR	4 885 603	4 886 261	10,76
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 10 - 07.04.42	4 000 000	EUR	4 039 775	4 051 080	8,92
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 00 - 01.04.31	8 700 000	EUR	9 068 139	9 079 842	19,99
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	2 500 000	EUR	2 549 793	2 570 325	5,66
DZ HY PAG 3.65% 05 - 28.12.20	7 100 000	EUR	7 237 095	7 235 326	15,93
Evonik Industries AG 1.00% 15 - 23.01.23	1 100 000	EUR	1 127 603	1 120 500	2,47
			34 078 435	34 119 084	75,13
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 98 - 11.01.29	600 000	EUR	502 121	529 074	1,17
			502 121	529 074	1,17
Jersey					
Glencore Finance Europe Ltd. 1.25% 15 - 17.03.21	1 900 000	EUR	1 912 303	1 899 031	4,18
			1 912 303	1 899 031	4,18
Espagne					
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 01 - 30.07.29	1 000 000	EUR	938 032	962 240	2,12
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 15 - 30.07.20	1 200 000	EUR	1 200 334	1 200 372	2,64
			2 138 366	2 162 612	4,76
Royaume-Uni					
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	2 900 000	EUR	3 244 978	3 184 698	7,01
			3 244 978	3 184 698	7,01
États-Unis					
BorgWarner Inc. 1.80% 15 - 11.07.22	1 200 000	EUR	1 244 795	1 217 084	2,68
			1 244 795	1 217 084	2,68
Total - Obligations			45 315 574	45 252 835	99,65
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			45 315 574	45 252 835	99,65
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			45 315 574	45 252 835	99,65
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				45 469 749	100,13

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Angola					
Angola 8.00% 19 - 26.11.29	6 100 000	USD	5 563 322	5 002 000	0,31
Angola 8.25% 18 - 05.09.28	5 800 000	USD	5 335 447	4 756 000	0,30
Angola 8.25% 18 - 05.09.28	500 000	USD	437 980	410 000	0,03
Angola 9.125% 19 - 26.11.49	4 600 000	USD	4 118 385	3 716 800	0,23
Angola 9.375% 18 - 05.08.48	5 800 000	USD	5 550 447	4 699 740	0,29
Angola 9.375% 18 - 05.08.48	300 000	USD	323 193	243 090	0,02
Angola 9.50% 15 - 11.12.25	5 300 000	USD	5 373 021	4 747 210	0,30
			26 701 795	23 574 840	1,48
Azerbaïdjan					
Azerbaijan 4.75% 14 - 18.03.24	3 700 000	USD	3 813 784	3 938 872	0,25
Azerbaijan 4.75% 14 - 18.03.24	700 000	USD	715 883	745 192	0,05
Southern Gas Corridor CJSC 6.875% 16 - 24.03.26	4 180 000	USD	4 627 579	4 806 398	0,30
Southern Gas Corridor CJSC 6.875% 16 - 24.03.26	2 820 000	USD	3 093 936	3 242 594	0,20
			12 251 182	12 733 056	0,80
Bahreïn					
Bahrain 5.625% 19 - 30.09.31	3 600 000	USD	3 694 887	3 635 100	0,23
Bahrain 6.00% 14 - 19.09.44	4 000 000	USD	3 678 743	3 946 720	0,25
Bahrain 6.00% 14 - 19.09.44	400 000	USD	356 263	394 672	0,02
Bahrain 6.125% 12 - 07.05.22	5 400 000	USD	5 541 529	5 625 990	0,35
Bahrain 6.125% 13 - 08.01.23	4 800 000	USD	4 945 001	5 073 158	0,32
Bahrain 6.125% 13 - 08.01.23	600 000	USD	628 386	634 145	0,04
Bahrain 6.75% 17 - 20.09.29	4 300 000	USD	4 501 137	4 703 168	0,29
Bahrain 7.00% 15 - 26.01.26	4 000 000	USD	4 268 503	4 439 280	0,28
Bahrain 7.00% 16 - 10.12.28	4 800 000	USD	5 013 614	5 345 194	0,33
Bahrain 7.00% 16 - 10.12.28	1 000 000	USD	1 074 390	1 113 582	0,07
Bahrain 7.375% 20 - 14.05.30	3 600 000	USD	3 850 759	4 092 120	0,26
CBB International Sukuk Co. SPC 5.624% 16 - 02.12.24	3 300 000	USD	3 356 914	3 435 023	0,22
CBB International Sukuk Co. SPC 6.875% 18 - 10.05.25	3 400 000	USD	3 621 434	3 781 072	0,24
			44 531 560	46 219 224	2,90
Brésil					
Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 5.75% 13 - 26.09.23	2 000 000	USD	2 106 042	2 157 520	0,14
Brazil 2.625% 12 - 01.05.23	3 900 000	USD	3 844 542	3 978 000	0,25
Brazil 4.25% 13 - 01.07.25	7 600 000	USD	7 784 983	7 980 000	0,50
Brazil 4.50% 19 - 30.05.29	3 700 000	USD	3 760 891	3 799 863	0,24
Brazil 4.625% 17 - 13.01.28	5 600 000	USD	5 716 395	5 863 200	0,37
Brazil 4.75% 19 - 14.01.50	4 600 000	USD	4 449 294	4 312 500	0,27
Brazil 5.00% 14 - 27.01.45	6 000 000	USD	5 687 542	5 752 500	0,36
Brazil 5.625% 09 - 01.07.41	4 200 000	USD	4 350 849	4 368 000	0,27
Brazil 5.625% 16 - 21.02.47	5 200 000	USD	5 338 547	5 408 000	0,34
Brazil 6.00% 16 - 04.07.26	4 100 000	USD	4 526 654	4 633 000	0,29
Brazil 7.125% 06 - 20.01.37	3 100 000	USD	3 682 225	3 712 281	0,23
Brazil 8.25% 04 - 20.01.34	2 100 000	USD	2 700 597	2 724 750	0,17
Brazil 8.875% 01 - 15.04.24	1 900 000	USD	2 286 300	2 341 750	0,15
			56 234 861	57 031 364	3,58

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Chili					
Chile 2.45% 20 - 31.01.31	5 100 000	USD	5 231 707	5 283 243	0,33
Chile 3.24% 18 - 02.06.28	7 000 000	USD	7 137 381	7 672 070	0,48
Chile 3.50% 19 - 25.01.50	8 300 000	USD	8 755 662	9 300 233	0,58
Chile 3.86% 17 - 21.06.47	4 500 000	USD	4 735 069	5 340 780	0,34
Corp Nacional del Cobre de Chile 3.00% 19 - 30.09.29	3 800 000	USD	3 817 729	3 919 008	0,25
Corp Nacional del Cobre de Chile 3.70% 19 - 30.01.50	6 700 000	USD	6 784 397	6 796 877	0,43
Corp Nacional del Cobre de Chile 4.375% 19 - 02.05.49	4 600 000	USD	4 728 966	5 165 397	0,32
Corp. Nacional del Cobre de Chile 3.625% 17 - 08.01.27	5 400 000	USD	5 478 256	5 766 057	0,36
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4.50% 15 - 16.09.25	3 800 000	USD	4 045 733	4 247 616	0,27
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4.50% 17 - 08.01.47	4 400 000	USD	4 605 292	4 989 237	0,31
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA 4.70% 20 - 05.07.50	3 600 000	USD	4 141 868	4 132 800	0,26
			59 462 060	62 613 318	3,93
Chine					
China 1.95% 19 - 12.03.24	6 900 000	USD	7 007 556	7 197 172	0,45
China 2.125% 17 - 11.02.22	3 800 000	USD	3 810 100	3 922 284	0,25
China 2.125% 19 - 12.03.29	7 000 000	USD	7 071 068	7 471 605	0,47
China 2.625% 17 - 11.02.27	3 700 000	USD	3 729 910	4 047 455	0,25
China 3.25% 18 - 19.10.23	5 100 000	USD	5 218 043	5 512 674	0,35
China 3.50% 18 - 19.10.28	3 500 000	USD	3 701 624	4 079 337	0,26
Export-Import Bank of China 2.875% 16 - 26.04.26	3 200 000	USD	3 185 460	3 442 317	0,21
Export-Import Bank of China 2.875% 16 - 26.04.26	400 000	USD	417 390	430 290	0,03
Export-Import Bank of China 3.625% 14 - 31.07.24	5 200 000	USD	5 351 588	5 723 462	0,36
			39 492 739	41 826 596	2,63
Colombie					
Colombia 2.625% 13 - 15.03.23	3 300 000	USD	3 254 017	3 339 633	0,21
Colombia 3.00% 20 - 30.01.30	5 300 000	USD	5 303 252	5 212 603	0,33
Colombia 3.875% 17 - 25.04.27	8 200 000	USD	8 333 501	8 630 582	0,54
Colombia 4.00% 13 - 26.02.24	7 200 000	USD	7 375 737	7 570 800	0,47
Colombia 4.50% 15 - 28.01.26	5 100 000	USD	5 340 766	5 508 051	0,35
Colombia 4.50% 18 - 15.03.29	6 800 000	USD	7 131 478	7 422 064	0,47
Colombia 5.00% 15 - 15.06.45	15 400 000	USD	16 217 794	17 363 500	1,09
Colombia 5.20% 19 - 15.05.49	6 200 000	USD	6 920 774	7 232 610	0,45
Colombia 5.625% 14 - 26.02.44	8 500 000	USD	9 612 971	10 170 250	0,64
Colombia 6.125% 09 - 18.01.41	8 900 000	USD	10 519 710	11 080 500	0,70
Colombia 7.375% 06 - 18.09.37	6 400 000	USD	8 382 932	8 729 600	0,55
Colombia 8.125% 04 - 21.05.24	3 520 000	USD	4 081 172	4 224 000	0,26
Empresas Publicas de Medellin ESP 4.25% 19 - 18.07.29	3 500 000	USD	3 587 764	3 508 750	0,22
			96 061 868	99 992 943	6,28
Costa Rica					
Costa Rica 4.25% 12 - 26.01.23	3 500 000	USD	3 368 072	3 290 035	0,21

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Costa Rica (suite)					
Costa Rica 7.00% 14 - 04.04.44	3 600 000	USD	3 298 805	2 921 436	0,18
Costa Rica 7.158% 15 - 03.12.45	4 600 000	USD	4 301 676	3 806 546	0,24
			10 968 553	10 018 017	0,63
Croatie					
Croatia 5.50% 13 - 04.04.23	5 200 000	USD	5 530 464	5 720 000	0,36
Croatia 6.00% 13 - 26.01.24	3 240 000	USD	3 541 699	3 706 236	0,23
Croatia 6.00% 13 - 26.01.24	1 500 000	USD	1 623 609	1 715 850	0,11
Croatia 6.00% 13 - 26.01.24	1 360 000	USD	1 504 247	1 555 704	0,10
			12 200 019	12 697 790	0,80
République Dominicaine					
Dominican Republic 4.50% 20 - 30.01.30	3 500 000	USD	3 398 987	3 150 035	0,20
Dominican Republic 5.50% 15 - 27.01.25	5 300 000	USD	5 394 146	5 353 053	0,34
Dominican Republic 5.875% 20 - 30.01.60	5 300 000	USD	5 092 890	4 478 500	0,28
Dominican Republic 5.95% 17 - 25.01.27	6 200 000	USD	6 396 340	6 215 562	0,39
Dominican Republic 6.00% 18 - 19.07.28	4 600 000	USD	4 687 636	4 620 700	0,29
Dominican Republic 6.40% 19 - 06.05.49	5 400 000	USD	5 585 717	4 876 200	0,31
Dominican Republic 6.50% 18 - 15.02.48	3 450 000	USD	3 435 150	3 148 160	0,20
Dominican Republic 6.85% 15 - 27.01.45	7 300 000	USD	7 498 339	6 935 073	0,43
Dominican Republic 6.875% 16 - 29.01.26	5 300 000	USD	5 708 460	5 551 750	0,35
Dominican Republic 7.45% 14 - 30.04.44	5 000 000	USD	5 428 608	5 125 050	0,32
			52 626 273	49 454 083	3,11
Équateur					
Ecuador 7.775% 18 - 23.01.28	10 400 000	USD	8 245 437	4 264 104	0,27
Ecuador 7.775% 18 - 23.01.28	100 000	USD	86 409	41 001	0,00
Ecuador 7.95% 14 - 20.06.24	6 800 000	USD	5 618 517	3 357 500	0,21
Ecuador 7.95% 14 - 20.06.24	100 000	USD	90 500	49 375	0,01
Ecuador 8.75% 17 - 06.02.23	8 500 000	USD	7 094 644	3 846 250	0,24
Ecuador 8.875% 17 - 23.10.27	8 800 000	USD	7 247 389	3 685 000	0,23
Ecuador 9.50% 19 - 27.03.30	5 000 000	USD	4 029 904	2 118 750	0,13
Ecuador 9.625% 17 - 06.02.27	1 900 000	USD	1 267 487	802 769	0,05
Ecuador 9.625% 17 - 06.02.27	1 900 000	USD	1 820 975	802 769	0,05
Ecuador 9.65% 16 - 13.12.26	6 800 000	USD	5 109 572	2 907 068	0,18
Ecuador 9.65% 16 - 13.12.26	1 900 000	USD	1 433 550	812 269	0,05
Ecuador 10.65% 19 - 31.01.29	1 700 000	USD	715 195	688 500	0,05
Ecuador 10.65% 19 - 31.01.29	5 900 000	USD	6 564 479	2 389 500	0,15
			49 324 058	25 764 855	1,62
Égypte					
Egypt 5.577% 18 - 21.02.23	4 400 000	USD	4 418 897	4 494 468	0,28
Egypt 5.75% 20 - 29.05.24	4 400 000	USD	4 414 217	4 410 287	0,28
Egypt 5.875% 15 - 06.11.25	1 409 000	USD	1 411 361	1 416 045	0,09
Egypt 5.875% 15 - 06.11.25	3 700 000	USD	3 657 602	3 718 500	0,23
Egypt 5.875% 15 - 06.11.25	91 000	USD	89 203	91 455	0,01
Egypt 6.588% 18 - 21.02.28	3 900 000	USD	3 798 364	3 845 057	0,24
Egypt 6.588% 18 - 21.02.28	400 000	USD	405 307	394 365	0,03
Egypt 7.053% 19 - 15.01.32	3 500 000	USD	3 488 385	3 316 250	0,21
Egypt 7.50% 17 - 31.01.27	6 450 000	USD	6 634 344	6 748 312	0,42
Egypt 7.50% 17 - 31.01.27	750 000	USD	763 510	784 688	0,05
Egypt 7.60% 19 - 03.01.29	6 400 000	USD	6 623 853	6 508 032	0,41

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Égypte (suite)					
Egypt 7.625% 20 - 29.05.32	6 200 000	USD	6 101 123	6 043 450	0,38
Egypt 7.903% 18 - 21.02.48	3 706 000	USD	3 556 801	3 420 697	0,22
Egypt 7.903% 18 - 21.02.48	1 394 000	USD	1 313 188	1 286 684	0,08
Egypt 8.50% 17 - 31.01.47	6 350 000	USD	6 462 906	6 192 266	0,39
Egypt 8.50% 17 - 31.01.47	210 000	USD	175 238	204 784	0,01
Egypt 8.50% 17 - 31.01.47	2 340 000	USD	2 287 640	2 281 874	0,14
Egypt 8.70% 19 - 03.01.49	4 900 000	USD	5 057 671	4 798 619	0,30
Egypt 8.70% 19 - 03.01.49	400 000	USD	432 943	391 724	0,02
Egypt 8.875% 20 - 29.05.50	7 200 000	USD	7 135 592	7 103 952	0,45
			68 228 145	67 451 509	4,24
Salvador					
El Salvador 7.125% 19 - 20.01.50	3 900 000	USD	3 845 056	3 161 730	0,20
El Salvador 7.65% 05 - 15.06.35	3 500 000	USD	3 430 240	3 062 500	0,19
			7 275 296	6 224 230	0,39
Éthiopie					
Ethiopia 6.625% 14 - 12.11.24	1 632 000	USD	1 587 585	1 623 487	0,10
Ethiopia 6.625% 14 - 12.11.24	1 268 000	USD	1 246 138	1 261 386	0,08
Ethiopia 6.625% 14 - 12.11.24	700 000	USD	713 849	696 349	0,05
			3 547 572	3 581 222	0,23
Hongrie					
Hungary 5.375% 13 - 21.02.23	6 400 000	USD	6 810 533	7 007 872	0,44
Hungary 5.375% 14 - 25.03.24	6 500 000	USD	7 037 999	7 373 600	0,47
Hungary 5.75% 13 - 22.11.23	6 200 000	USD	6 752 882	7 043 076	0,44
Hungary 7.625% 11 - 29.03.41	4 400 000	USD	6 698 924	7 358 428	0,46
			27 300 338	28 782 976	1,81
Inde					
Export-Import Bank of India 3.25% 20 - 15.01.30	3 400 000	USD	3 411 438	3 360 235	0,21
Export-Import Bank of India 3.375% 16 - 08.05.26	3 700 000	USD	3 628 113	3 802 943	0,24
Export-Import Bank of India 3.875% 18 - 02.01.28	3 600 000	USD	3 586 254	3 731 036	0,23
			10 625 805	10 894 214	0,68
Indonésie					
Indonesia 2.85% 20 - 14.02.30	1 800 000	USD	1 797 054	1 837 235	0,12
Indonesia 2.95% 17 - 01.11.23	1 400 000	USD	1 394 539	1 439 442	0,09
Indonesia 3.30% 12 - 21.11.22	1 500 000	USD	1 508 171	1 549 485	0,10
Indonesia 3.375% 13 - 15.04.23	2 100 000	USD	2 111 168	2 183 079	0,14
Indonesia 3.50% 17 - 01.11.28	1 700 000	USD	1 681 717	1 806 913	0,11
Indonesia 3.70% 19 - 30.10.49	1 500 000	USD	1 534 884	1 553 289	0,10
Indonesia 3.75% 18 - 03.01.23	1 600 000	USD	1 624 472	1 673 376	0,11
Indonesia 3.85% 17 - 18.07.27	1 400 000	USD	1 428 021	1 515 724	0,10
Indonesia 3.85% 20 - 15.10.30	2 600 000	USD	2 765 346	2 888 755	0,18
Indonesia 4.10% 18 - 24.04.28	1 600 000	USD	1 705 257	1 770 236	0,11
Indonesia 4.125% 15 - 15.01.25	2 900 000	USD	2 993 592	3 146 145	0,20
Indonesia 4.15% 17 - 29.03.27	3 100 000	USD	3 201 950	3 368 832	0,21
Indonesia 4.20% 20 - 15.10.50	2 400 000	USD	2 490 711	2 674 566	0,17
Indonesia 4.325% 15 - 28.05.25	2 800 000	USD	2 870 926	3 066 392	0,19
Indonesia 4.35% 14 - 09.10.24	2 300 000	USD	2 388 438	2 498 076	0,16
Indonesia 4.35% 16 - 01.08.27	1 900 000	USD	1 977 553	2 108 590	0,13
Indonesia 4.35% 17 - 01.11.48	2 600 000	USD	2 576 442	2 926 656	0,18

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Indonésie (suite)					
Indonesia 4.40% 18 - 03.01.28	2 660 000	USD	2 752 133	2 952 946	0,19
Indonesia 4.45% 19 - 20.02.29	1 700 000	USD	1 785 781	1 902 300	0,12
Indonesia 4.45% 20 - 15.04.70	1 400 000	USD	1 438 998	1 604 983	0,10
Indonesia 4.55% 16 - 29.03.26	2 600 000	USD	2 692 935	2 874 092	0,18
Indonesia 4.625% 13 - 15.04.43	2 300 000	USD	2 411 623	2 634 621	0,17
Indonesia 4.75% 15 - 01.08.26	3 200 000	USD	3 422 213	3 602 528	0,23
Indonesia 4.75% 17 - 18.07.47	1 400 000	USD	1 470 642	1 641 314	0,10
Indonesia 4.75% 18 - 02.11.29	1 700 000	USD	1 864 308	1 968 036	0,12
Indonesia 5.125% 15 - 15.01.45	2 800 000	USD	3 045 159	3 425 756	0,22
Indonesia 5.25% 12 - 17.01.42	3 400 000	USD	3 841 094	4 205 758	0,26
Indonesia 5.25% 16 - 01.08.47	2 000 000	USD	2 176 356	2 498 727	0,16
Indonesia 5.35% 18 - 02.11.49	1 400 000	USD	1 636 378	1 810 801	0,11
Indonesia 5.375% 13 - 17.10.23	1 500 000	USD	1 592 728	1 664 724	0,10
Indonesia 5.875% 14 - 15.01.24	2 900 000	USD	3 148 965	3 284 999	0,21
Indonesia 5.95% 15 - 01.08.46	2 000 000	USD	2 498 385	2 724 639	0,17
Indonesia 6.625% 07 - 17.02.37	2 200 000	USD	2 746 329	3 004 104	0,19
Indonesia 6.75% 14 - 15.01.44	2 800 000	USD	3 639 228	4 085 956	0,26
Indonesia 7.75% 08 - 17.01.38	2 900 000	USD	4 043 726	4 367 233	0,27
Indonesia 8.50% 05 - 10.12.35	2 500 000	USD	3 602 827	3 884 760	0,24
Pertamina Persero PT 4.175% 20 - 21.01.50	1 500 000	USD	1 471 038	1 480 342	0,09
Pertamina Persero PT 4.30% 13 - 20.05.23	2 300 000	USD	2 348 489	2 427 343	0,15
Pertamina Persero PT 5.625% 13 - 20.05.43	2 000 000	USD	2 158 871	2 307 222	0,14
Pertamina Persero PT 6.00% 12 - 05.03.42	1 800 000	USD	1 963 112	2 132 973	0,13
Pertamina Persero PT 6.45% 14 - 30.05.44	2 280 000	USD	2 686 169	2 905 730	0,18
			96 487 728	103 398 678	6,49
Irak					
Iraq 6.752% 17 - 03.09.23	3 200 000	USD	3 096 724	2 936 384	0,19
Iraq 6.752% 17 - 03.09.23	400 000	USD	401 079	367 048	0,02
			3 497 803	3 303 432	0,21
Irlande					
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 5.942% 13 - 21.11.23	3 300 000	USD	3 484 218	3 663 000	0,23
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 6.025% 12 - 07.05.22	2 200 000	USD	2 245 949	2 348 126	0,15
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 6.025% 12 - 07.05.22	200 000	USD	213 891	213 466	0,01
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 6.80% 10 - 22.11.25	2 700 000	USD	2 971 841	3 216 240	0,20
			8 915 899	9 440 832	0,59
Jamaïque					
Jamaica 7.875% 15 - 28.07.45	6 500 000	USD	7 988 290	7 891 650	0,50
			7 988 290	7 891 650	0,50
Jordanie					
Jordan 5.75% 16 - 31.01.27	3 120 000	USD	3 058 432	3 230 074	0,20
Jordan 5.75% 16 - 31.01.27	280 000	USD	277 851	289 878	0,02
Jordan 6.125% 15 - 29.01.26	2 060 000	USD	2 098 136	2 167 923	0,14
Jordan 6.125% 15 - 29.01.26	1 340 000	USD	1 363 662	1 410 203	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 30 juin 2020
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Jordanie (suite)					
Jordan 7.375% 17 - 10.10.47	2 510 000	USD	2 453 711	2 579 025	0,16
Jordan 7.375% 17 - 10.10.47	1 090 000	USD	1 042 339	1 119 975	0,07
			10 294 131	10 797 078	0,68
Kazakhstan					
Development Bank of Kazakhstan JSC 4.125% 12 - 12.10.22	3 861 000	USD	3 884 070	4 004 899	0,25
Development Bank of Kazakhstan JSC 4.125% 12 - 12.10.22	439 000	USD	447 552	455 362	0,03
Kazakhstan 3.875% 14 - 14.10.24	4 807 000	USD	5 010 252	5 238 611	0,33
Kazakhstan 3.875% 14 - 14.10.24	493 000	USD	509 775	537 265	0,03
Kazakhstan 4.875% 14 - 14.10.44	3 200 000	USD	3 565 311	4 055 200	0,26
Kazakhstan 4.875% 14 - 14.10.44	200 000	USD	232 566	253 450	0,02
Kazakhstan 5.125% 15 - 21.07.25	8 300 000	USD	9 071 695	9 607 250	0,60
Kazakhstan 5.125% 15 - 21.07.25	400 000	USD	432 662	463 000	0,03
Kazakhstan 6.50% 15 - 21.07.45	4 200 000	USD	5 596 481	6 205 500	0,39
Kazakhstan 6.50% 15 - 21.07.45	1 200 000	USD	1 555 666	1 773 000	0,11
			30 306 030	32 593 537	2,05
Kenya					
Kenya 6.875% 14 - 24.06.24	7 000 000	USD	7 022 711	7 100 730	0,44
Kenya 6.875% 14 - 24.06.24	300 000	USD	300 072	304 317	0,02
Kenya 7.25% 18 - 28.02.28	3 200 000	USD	3 164 180	3 153 408	0,20
Kenya 7.25% 18 - 28.02.28	300 000	USD	302 685	295 632	0,02
Kenya 8.25% 18 - 28.02.48	3 500 000	USD	3 423 413	3 440 850	0,22
			14 213 061	14 294 937	0,90
Malaisie					
Malaysia Sovereign Sukuk Bhd 3.043% 15 - 22.04.25	3 600 000	USD	3 627 874	3 864 603	0,24
Malaysia Sukuk Global Bhd 3.179% 16 - 27.04.26	3 650 000	USD	3 740 266	3 978 827	0,25
			7 368 140	7 843 430	0,49
Mexique					
Comision Federal de Electricidad 4.75% 16 - 23.02.27	800 000	USD	816 420	841 000	0,05
Comision Federal de Electricidad 4.875% 13 - 15.01.24	1 100 000	USD	1 128 982	1 157 750	0,07
Mexico 3.25% 20 - 16.04.30	2 800 000	USD	2 850 515	2 759 428	0,17
Mexico 3.60% 14 - 30.01.25	1 700 000	USD	1 729 620	1 801 320	0,11
Mexico 3.75% 18 - 01.11.28	1 800 000	USD	1 793 208	1 871 154	0,12
Mexico 3.90% 20 - 27.04.25	700 000	USD	738 599	747 250	0,05
Mexico 4.00% 13 - 10.02.23	2 400 000	USD	2 464 607	2 547 624	0,16
Mexico 4.125% 16 - 21.01.26	2 000 000	USD	2 077 996	2 160 020	0,14
Mexico 4.15% 17 - 28.03.27	2 400 000	USD	2 463 553	2 571 000	0,16
Mexico 4.35% 16 - 15.01.47	1 500 000	USD	1 453 192	1 497 360	0,09
Mexico 4.50% 19 - 22.04.29	2 900 000	USD	3 070 723	3 139 250	0,20
Mexico 4.50% 19 - 31.01.50	2 400 000	USD	2 446 184	2 448 000	0,15
Mexico 4.60% 15 - 23.01.46	2 500 000	USD	2 408 490	2 568 000	0,16
Mexico 4.60% 17 - 02.10.48	2 100 000	USD	2 094 678	2 149 875	0,14
Mexico 4.75% 12 - 03.08.44	3 600 000	USD	3 699 647	3 780 000	0,24
Mexico 4.75% 20 - 27.04.32	2 100 000	USD	2 283 395	2 303 700	0,15
Mexico 5.00% 20 - 27.04.51	2 200 000	USD	2 390 141	2 359 500	0,15
Mexico 5.55% 14 - 21.01.45	2 200 000	USD	2 347 671	2 577 014	0,16

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Mexique (suite)					
Mexico 5.75% 10 - 10.12.10	2 200 000	USD	2 264 024	2 400 750	0,15
Mexico 6.05% 08 - 01.11.40	2 500 000	USD	2 903 406	3 039 950	0,19
Mexico 6.75% 04 - 27.09.34	1 600 000	USD	2 038 813	2 104 016	0,13
Mexico 8.30% 01 - 15.08.31	940 000	USD	1 255 793	1 332 450	0,08
Petroleos Mexicanos 3.50% 13 - 30.01.23	800 000	USD	802 839	759 200	0,05
Petroleos Mexicanos 4.50% 16 - 23.01.26	1 200 000	USD	1 087 892	1 047 000	0,07
Petroleos Mexicanos 4.875% 13 - 18.01.24	1 000 000	USD	972 598	957 500	0,06
Petroleos Mexicanos 5.35% 18 - 02.12.28	2 200 000	USD	1 962 322	1 822 062	0,11
Petroleos Mexicanos 5.95% 20 - 28.01.31	3 400 000	USD	3 161 622	2 764 200	0,17
Petroleos Mexicanos 6.35% 18 - 02.12.48	2 400 000	USD	2 095 647	1 764 552	0,11
Petroleos Mexicanos 6.375% 14 - 23.01.45	1 300 000	USD	1 144 523	959 244	0,06
Petroleos Mexicanos 6.49% 19 - 23.01.27	1 900 000	USD	1 842 511	1 726 625	0,11
Petroleos Mexicanos 6.50% 11 - 06.02.41	1 300 000	USD	1 156 040	982 150	0,06
Petroleos Mexicanos 6.50% 18 - 13.03.27	4 500 000	USD	4 399 301	4 068 045	0,26
Petroleos Mexicanos 6.50% 18 - 23.01.29	1 700 000	USD	1 634 251	1 472 625	0,09
Petroleos Mexicanos 6.625% 06 - 15.06.35	2 200 000	USD	2 035 644	1 765 500	0,11
Petroleos Mexicanos 6.75% 17 - 21.09.47	5 000 000	USD	4 379 344	3 797 250	0,24
Petroleos Mexicanos 6.84% 19 - 23.01.30	2 700 000	USD	2 649 018	2 339 928	0,15
Petroleos Mexicanos 6.875% 17 - 08.04.26	2 700 000	USD	2 785 057	2 557 440	0,16
Petroleos Mexicanos 6.95% 20 - 28.01.60	3 300 000	USD	2 989 808	2 507 142	0,16
Petroleos Mexicanos 7.69% 19 - 23.01.50	6 800 000	USD	6 869 933	5 582 120	0,35
			88 688 007	85 028 994	5,34
Mongolie					
Mongolia 5.125% 12 - 12.05.22	3 400 000	USD	3 362 621	3 365 786	0,21
			3 362 621	3 365 786	0,21
Maroc					
Morocco 4.25% 12 - 12.11.22	4 600 000	USD	4 702 572	4 841 077	0,30
Morocco 4.25% 12 - 12.11.22	600 000	USD	614 291	631 445	0,04
			5 316 863	5 472 522	0,34
Pays-Bas					
Petrobras Global Finance BV 5.093% 19 - 15.01.30	7 700 000	USD	7 914 006	7 599 900	0,48
Petrobras Global Finance BV 5.299% 18 - 27.01.25	4 000 000	USD	4 014 379	4 172 000	0,26
Petrobras Global Finance BV 5.75% 18 - 02.01.29	2 900 000	USD	2 971 902	2 972 500	0,19
Petrobras Global Finance BV 5.999% 18 - 27.01.28	4 900 000	USD	4 985 071	5 102 125	0,32
Petrobras Global Finance BV 6.25% 14 - 17.03.24	2 700 000	USD	2 845 640	2 887 974	0,18
Petrobras Global Finance BV 6.90% 19 - 19.03.49	4 100 000	USD	4 307 755	4 299 465	0,27
Petrobras Global Finance BV 7.375% 17 - 17.01.27	4 200 000	USD	4 593 779	4 668 930	0,29
Petrobras Global Finance BV 8.75% 16 - 23.05.26	3 700 000	USD	4 316 585	4 366 000	0,28
			35 949 117	36 068 894	2,27
Nigeria					
Nigeria 6.50% 17 - 28.11.27	5 300 000	USD	5 022 672	5 024 400	0,32
Nigeria 7.143% 18 - 23.02.30	4 500 000	USD	4 299 798	4 190 625	0,26
Nigeria 7.625% 17 - 28.11.47	5 300 000	USD	4 942 939	4 720 392	0,30
Nigeria 7.625% 18 - 21.11.25	3 800 000	USD	3 875 416	3 872 010	0,24
Nigeria 7.696% 18 - 23.02.38	4 000 000	USD	3 813 908	3 640 000	0,23
Nigeria 7.696% 18 - 23.02.38	400 000	USD	346 748	364 000	0,02
Nigeria 7.875% 17 - 16.02.32	4 500 000	USD	4 377 744	4 231 080	0,27

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Nigeria (suite)					
Nigeria 7.875% 17 - 16.02.32	900 000	USD	984 803	846 216	0,05
Nigeria 8.747% 18 - 21.01.31	3 500 000	USD	3 560 148	3 491 250	0,22
			31 224 176	30 379 973	1,91
Oman					
Oman 4.125% 18 - 17.01.23	4 400 000	USD	4 257 019	4 312 466	0,27
Oman 4.75% 16 - 15.06.26	8 800 000	USD	8 235 894	8 128 032	0,51
Oman 5.375% 17 - 03.08.27	5 549 000	USD	5 254 177	5 169 282	0,32
Oman 5.375% 17 - 03.08.27	1 551 000	USD	1 475 212	1 444 865	0,09
Oman 5.625% 18 - 17.01.28	8 339 000	USD	7 830 847	7 766 778	0,49
Oman 5.625% 18 - 17.01.28	361 000	USD	297 185	336 228	0,02
Oman 6.00% 19 - 08.01.29	8 000 000	USD	7 768 171	7 440 000	0,47
Oman 6.50% 17 - 03.08.47	6 730 000	USD	5 933 942	5 806 307	0,37
Oman 6.50% 17 - 03.08.47	570 000	USD	519 317	491 768	0,03
Oman 6.75% 18 - 17.01.48	9 300 000	USD	8 383 049	8 021 250	0,50
Oman 6.75% 18 - 17.01.48	300 000	USD	228 038	258 750	0,02
Oman Sovereign Sukuk SAOC 4.397% 17 - 06.01.24	6 900 000	USD	6 696 069	6 737 574	0,42
Oman Sovereign Sukuk SAOC 5.932% 18 - 31.10.25	5 300 000	USD	5 321 857	5 445 072	0,34
			62 200 777	61 358 372	3,85
Pakistan					
Pakistan 6.875% 17 - 12.05.27	5 200 000	USD	5 073 062	5 115 500	0,32
Pakistan 8.25% 14 - 15.04.24	3 700 000	USD	3 833 616	3 850 479	0,24
			8 906 678	8 965 979	0,56
Panama					
Panama 3.16% 19 - 23.01.30	5 500 000	USD	5 652 453	5 912 500	0,37
Panama 3.75% 15 - 16.03.25	4 600 000	USD	4 755 659	4 972 324	0,31
Panama 3.875% 16 - 17.03.28	4 600 000	USD	4 838 676	5 169 296	0,32
Panama 4.00% 14 - 22.09.24	4 200 000	USD	4 368 987	4 559 100	0,29
			19 615 775	20 613 220	1,29
Paraguay					
Paraguay 6.10% 14 - 08.11.44	3 600 000	USD	4 072 875	4 383 036	0,28
			4 072 875	4 383 036	0,28
Pérou					
Peru 2.392% 20 - 23.01.26	3 500 000	USD	3 578 691	3 633 105	0,23
Peru 2.783% 20 - 23.01.31	7 200 000	USD	7 459 890	7 668 000	0,48
Peru 4.125% 15 - 25.08.27	3 600 000	USD	3 899 790	4 126 536	0,26
Peru 5.625% 10 - 18.11.50	9 100 000	USD	12 136 345	14 350 700	0,90
Peru 7.35% 05 - 21.07.25	5 400 000	USD	6 519 091	6 871 824	0,43
Peru 8.75% 03 - 21.11.33	7 500 000	USD	11 531 306	12 506 325	0,79
Petroleos del Peru SA 4.75% 17 - 19.06.32	3 600 000	USD	3 740 989	3 996 000	0,25
Petroleos del Peru SA 5.625% 17 - 19.06.47	3 600 000	USD	3 855 279	4 201 596	0,26
			52 721 381	57 354 086	3,60
Philippines					
Philippine 2.457% 20 - 05.05.30	3 700 000	USD	3 882 762	3 874 603	0,24
Philippine 2.95% 20 - 05.05.45	4 700 000	USD	4 906 234	4 866 432	0,31
Philippine 3.00% 18 - 02.01.28	7 100 000	USD	7 175 255	7 655 679	0,48
Philippine 3.70% 16 - 03.01.41	7 100 000	USD	7 365 929	8 066 576	0,51
Philippine 3.70% 17 - 02.02.42	7 100 000	USD	7 376 699	8 107 745	0,51
Philippine 3.75% 19 - 14.01.29	5 400 000	USD	5 817 048	6 157 607	0,39

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Philippines (suite)					
Philippine 3.95% 15 - 20.01.40	7 200 000	USD	7 733 131	8 342 187	0,52
Philippine 4.20% 14 - 21.01.24	5 200 000	USD	5 468 522	5 648 292	0,35
Philippine 5.00% 12 - 13.01.37	4 700 000	USD	5 622 875	6 041 785	0,38
Philippine 5.50% 11 - 30.03.26	3 600 000	USD	4 120 966	4 308 732	0,27
Philippine 6.375% 07 - 15.01.32	3 600 000	USD	4 615 644	4 963 824	0,31
Philippine 6.375% 09 - 23.10.34	6 800 000	USD	8 982 189	9 774 544	0,61
Philippine 7.75% 06 - 14.01.31	6 100 000	USD	8 472 998	9 104 860	0,57
Philippine 9.50% 05 - 02.02.30	6 900 000	USD	10 303 941	11 215 812	0,70
Philippine 10.625% 00 - 16.03.25	5 200 000	USD	6 932 993	7 267 312	0,46
Power Sector Assets & Liabilities Management Corp. 7.39% 09 - 12.02.24	4 100 000	USD	4 809 087	5 019 125	0,32
			103 586 273	110 415 115	6,93
Pologne					
Poland 3.00% 12 - 17.03.23	7 000 000	USD	7 116 856	7 410 920	0,46
Poland 3.25% 16 - 04.06.26	6 200 000	USD	6 432 060	6 947 782	0,44
Poland 4.00% 14 - 22.01.24	6 900 000	USD	7 246 310	7 654 032	0,48
			20 795 226	22 012 734	1,38
Roumanie					
Romania 4.375% 13 - 22.08.23	5 300 000	USD	5 486 119	5 630 805	0,35
Romania 4.875% 14 - 22.01.24	3 400 000	USD	3 585 415	3 696 888	0,23
Romania 5.125% 18 - 15.06.48	4 200 000	USD	4 398 741	4 955 756	0,31
Romania 6.125% 14 - 22.01.44	3 600 000	USD	4 273 789	4 716 000	0,30
			17 744 064	18 999 449	1,19
Russie					
Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 17 - 23.06.27	6 200 000	USD	6 349 708	6 926 218	0,44
Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 17 - 23.06.27	200 000	USD	218 069	223 426	0,01
Russian Foreign Bond - Eurobond 4.375% 18 - 21.03.29	4 000 000	USD	4 292 628	4 545 000	0,29
Russian Foreign Bond - Eurobond 4.375% 18 - 21.03.29	4 200 000	USD	4 436 791	4 772 250	0,30
Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 16 - 27.05.26	7 400 000	USD	7 730 371	8 426 410	0,53
Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 16 - 27.05.26	800 000	USD	894 827	910 963	0,06
Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 13 - 16.09.23	6 800 000	USD	7 068 745	7 548 000	0,47
Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 13 - 16.09.23	1 400 000	USD	1 545 448	1 554 000	0,10
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.10% 19 - 28.03.35	1 600 000	USD	1 797 041	1 978 419	0,12
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.10% 19 - 28.03.35	7 000 000	USD	7 119 581	8 655 584	0,54
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.10% 19 - 28.03.35	2 400 000	USD	2 952 170	2 967 629	0,19
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.25% 17 - 23.06.47	16 200 000	USD	17 774 884	21 388 083	1,34

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Russie (suite)					
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.25% 17 - 23.06.47	2 800 000	USD	3 207 083	3 696 706	0,23
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.625% 12 - 04.04.42	7 800 000	USD	9 116 703	10 586 940	0,67
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.625% 12 - 04.04.42	400 000	USD	509 163	542 920	0,03
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.875% 13 - 16.09.43	3 400 000	USD	4 081 081	4 777 000	0,30
Russian Foreign Bond - Eurobond 5.875% 13 - 16.09.43	600 000	USD	795 970	843 000	0,05
Russian Foreign Bond - Eurobond 12.75% 98 - 24.06.28	5 878 000	USD	9 332 110	10 110 160	0,64
Russian Foreign Bond - Eurobond 12.75% 98 - 24.06.28	1 022 000	USD	1 688 276	1 757 840	0,11
			90 910 649	102 210 548	6,42
Afrique du Sud					
Eskom Holdings SOC Ltd. 6.35% 18 - 08.10.28	3 500 000	USD	3 560 607	3 500 000	0,22
Eskom Holdings SOC Ltd. 6.75% 13 - 08.06.23	3 300 000	USD	3 223 551	3 121 800	0,20
Eskom Holdings SOC Ltd. 6.75% 13 - 08.06.23	200 000	USD	205 867	189 200	0,01
Eskom Holdings SOC Ltd. 7.125% 15 - 02.11.25	3 900 000	USD	3 767 181	3 609 450	0,23
Eskom Holdings SOC Ltd. 7.125% 15 - 02.11.25	700 000	USD	659 850	647 850	0,04
South Africa 4.30% 16 - 10.12.28	7 200 000	USD	6 761 306	6 673 392	0,42
South Africa 4.665% 12 - 17.01.24	5 300 000	USD	5 343 284	5 400 700	0,34
South Africa 4.85% 17 - 27.09.27	3 600 000	USD	3 498 844	3 519 000	0,22
South Africa 4.85% 19 - 30.09.29	7 200 000	USD	7 013 525	6 807 168	0,43
South Africa 4.875% 16 - 14.04.26	4 500 000	USD	4 475 218	4 493 610	0,28
South Africa 5.00% 16 - 10.12.46	3 400 000	USD	2 947 859	2 785 756	0,17
South Africa 5.375% 14 - 24.07.44	3 400 000	USD	3 101 180	2 956 640	0,19
South Africa 5.65% 17 - 27.09.47	5 300 000	USD	4 904 954	4 599 976	0,29
South Africa 5.75% 19 - 30.09.49	10 600 000	USD	10 156 214	9 196 751	0,58
South Africa 5.875% 07 - 30.05.22	3 300 000	USD	3 408 707	3 483 480	0,22
South Africa 5.875% 13 - 16.09.25	7 200 000	USD	7 488 779	7 632 000	0,48
South Africa 5.875% 18 - 22.06.30	5 100 000	USD	5 148 840	5 180 580	0,32
			75 665 766	73 797 353	4,64
Sri Lanka					
Sri Lanka 5.75% 18 - 18.04.23	4 800 000	USD	4 143 688	3 359 777	0,21
Sri Lanka 5.875% 12 - 25.07.22	3 100 000	USD	3 003 301	2 417 834	0,15
Sri Lanka 6.20% 17 - 05.11.27	5 600 000	USD	4 866 656	3 612 114	0,23
Sri Lanka 6.75% 18 - 18.04.28	4 500 000	USD	3 699 241	2 902 705	0,18
Sri Lanka 6.825% 16 - 18.07.26	3 100 000	USD	2 806 958	2 030 594	0,13
Sri Lanka 6.85% 15 - 11.03.25	5 300 000	USD	4 732 328	3 524 698	0,22
Sri Lanka 6.85% 19 - 14.03.24	3 500 000	USD	3 337 001	2 432 421	0,15
Sri Lanka 7.55% 19 - 28.03.30	5 300 000	USD	5 025 116	3 432 366	0,22
Sri Lanka 7.85% 19 - 14.03.29	5 000 000	USD	4 654 766	3 256 636	0,20
			36 269 055	26 969 145	1,69
Trinité-et-Tobago					
Trinidad and Tobago 4.50% 16 - 08.04.26	3 600 000	USD	3 539 524	3 654 036	0,23
			3 539 524	3 654 036	0,23

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Tunisie					
Tunisia 5.75% 15 - 30.01.25	2 900 000	USD	2 616 776	2 680 845	0,17
Tunisia 5.75% 15 - 30.01.25	700 000	USD	662 892	647 100	0,04
			3 279 668	3 327 945	0,21
Turquie					
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 4.489% 14 - 25.11.24	1 500 000	USD	1 417 952	1 429 746	0,09
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 5.004% 17 - 04.06.23	1 800 000	USD	1 754 584	1 782 238	0,11
Turkey 3.25% 13 - 23.03.23	2 300 000	USD	2 164 143	2 170 924	0,14
Turkey 4.25% 15 - 14.04.26	2 200 000	USD	1 984 243	2 002 198	0,13
Turkey 4.25% 20 - 13.03.25	3 100 000	USD	2 942 554	2 884 190	0,18
Turkey 4.875% 13 - 16.04.43	4 600 000	USD	3 514 987	3 545 450	0,22
Turkey 4.875% 16 - 10.09.26	4 500 000	USD	4 091 417	4 170 060	0,26
Turkey 5.125% 18 - 17.02.28	2 900 000	USD	2 609 756	2 665 854	0,17
Turkey 5.25% 20 - 13.03.30	3 200 000	USD	2 917 591	2 864 000	0,18
Turkey 5.60% 19 - 14.11.24	3 700 000	USD	3 693 238	3 635 250	0,23
Turkey 5.75% 14 - 22.03.24	3 800 000	USD	3 749 229	3 769 190	0,24
Turkey 5.75% 17 - 05.11.47	5 400 000	USD	4 477 700	4 396 950	0,28
Turkey 6.00% 11 - 14.01.41	4 500 000	USD	3 906 539	3 881 115	0,24
Turkey 6.00% 17 - 25.03.27	4 900 000	USD	4 733 541	4 777 128	0,30
Turkey 6.125% 18 - 24.10.28	3 000 000	USD	2 850 448	2 907 300	0,18
Turkey 6.25% 12 - 26.09.22	3 800 000	USD	3 816 299	3 847 044	0,24
Turkey 6.35% 19 - 08.10.24	3 400 000	USD	3 428 296	3 434 000	0,21
Turkey 6.625% 14 - 17.02.45	4 600 000	USD	4 196 000	4 174 500	0,26
Turkey 6.75% 10 - 30.05.40	3 000 000	USD	2 841 825	2 820 000	0,18
Turkey 6.875% 06 - 17.03.36	4 200 000	USD	4 044 549	4 083 786	0,26
Turkey 7.25% 08 - 03.05.38	1 300 000	USD	1 263 747	1 300 000	0,08
Turkey 7.25% 18 - 23.12.23	2 800 000	USD	2 857 998	2 910 331	0,18
Turkey 7.375% 05 - 02.05.25	4 900 000	USD	5 027 737	5 158 818	0,32
Turkey 7.625% 19 - 26.04.29	4 700 000	USD	4 911 069	4 942 792	0,31
Turkey 8.00% 04 - 14.02.34	2 300 000	USD	2 444 600	2 479 630	0,16
Turkey 11.875% 00 - 15.01.30	2 100 000	USD	2 726 909	2 841 090	0,18
			84 366 951	84 873 584	5,33
Ukraine					
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.22	4 338 000	USD	4 361 192	4 512 639	0,28
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.25	1 100 000	USD	1 094 116	1 144 986	0,07
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.26	246 000	USD	250 032	255 836	0,02
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.27	3 491 000	USD	3 364 192	3 621 913	0,23
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.22	362 000	USD	372 609	376 573	0,02
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.23	2 300 000	USD	2 344 969	2 406 725	0,15
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.23	2 300 000	USD	2 215 069	2 406 725	0,15
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.24	4 700 000	USD	4 670 126	4 890 406	0,31
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.25	3 700 000	USD	3 675 024	3 851 315	0,24
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.26	3 224 000	USD	3 164 280	3 352 908	0,21
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.26	1 230 000	USD	1 239 221	1 279 180	0,08
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.27	100 000	USD	92 670	103 750	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Ukraine (suite)					
Ukraine 7.75% 15 - 09.01.27	1 109 000	USD	1 111 912	1 150 588	0,07
Ukraine 9.75% 18 - 11.01.28	5 600 000	USD	6 022 087	6 367 984	0,40
			33 977 499	35 721 528	2,24
Vietnam					
Vietnam 4.80% 14 - 19.11.24	3 600 000	USD	3 759 269	3 923 471	0,25
			3 759 269	3 923 471	0,25
Zambie					
Zambia 8.50% 14 - 14.04.24	3 300 000	USD	2 322 753	1 740 750	0,11
Zambia 8.50% 14 - 14.04.24	300 000	USD	277 119	158 250	0,01
			2 599 872	1 899 000	0,12
Total - Obligations			1 544 455 292	1 549 218 581	97,30
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 544 455 292	1 549 218 581	97,30
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire^(A)					
Obligations					
Chili					
Corp Nacional del Cobre de Chile 3.15% 20 - 14.01.30	3 600 000	USD	3 631 074	3 741 912	0,23
			3 631 074	3 741 912	0,23
Total - Obligations			3 631 074	3 741 912	0,23
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			3 631 074	3 741 912	0,23
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 548 086 366	1 552 960 493	97,53
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 577 942 162	99,10

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Autriche					
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	400 000	EUR	692 782	788 412	1,84
			692 782	788 412	1,84
Canada					
Canada 5.00% 04 - 06.01.37	100 000	CAD	94 419	108 292	0,25
			94 419	108 292	0,25
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.24	1 300 000	EUR	1 300 099	1 330 121	3,11
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.30	1 400 000	EUR	1 299 288	1 415 806	3,31
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.45	2 100 000	EUR	1 404 554	1 800 729	4,21
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.41	2 501 000	EUR	1 831 847	2 248 224	5,26
			5 835 788	6 794 880	15,89
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.23	3 600 000	EUR	3 660 621	3 670 848	8,58
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.31	500 000	EUR	533 495	521 620	1,22
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.32	4 300 000	EUR	4 368 262	4 475 526	10,46
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.34	4 700 000	EUR	4 732 457	4 915 307	11,49
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 07 - 07.04.38	1 800 000	EUR	1 880 857	1 845 684	4,32
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 14 - 15.08.40	200 000	EUR	174 462	204 106	0,48
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 00 - 01.04.31	7 900 000	EUR	8 234 288	8 244 914	19,28
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	6 900 000	EUR	7 037 430	7 094 097	16,59
HeidelbergCement AG 2.25% 16 - 30.03.23	450 000	EUR	482 215	465 932	1,09
			31 104 087	31 438 034	73,51
Espagne					
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 15 - 30.07.22	2 300 000	EUR	2 307 205	2 315 548	5,41
			2 307 205	2 315 548	5,41
Supranationales					
European Investment Bank 1.00% 16 - 14.04.32	500 000	EUR	566 244	570 765	1,34
			566 244	570 765	1,34
Total - Obligations			40 600 525	42 015 931	98,24
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			40 600 525	42 015 931	98,24

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.26	600 000	EUR	548 645 548 645	569 616 569 616	1,33 1,33
Total - Obligations			548 645	569 616	1,33
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			548 645	569 616	1,33
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			41 149 170	42 585 547	99,57
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				42 596 005	99,60

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Allemagne					
Bayerische Landesbank 1.75% 14 - 04.08.24	500 000	EUR	528 500	539 609	0,66
Bayerische Landesbank 2.00% 12 - 07.11.22	1 500 000	EUR	1 603 305	1 571 820	1,93
Berlin Hyp AG 0.50% 16 - 26.09.23	100 000	EUR	99 494	100 288	0,12
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.21	1 000 000	EUR	1 007 118	1 005 210	1,23
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.22	3 800 000	EUR	3 841 048	3 849 970	4,72
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.25	2 000 000	EUR	2 031 302	2 065 000	2,53
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.26	1 800 000	EUR	1 837 070	1 862 352	2,28
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.29	3 200 000	EUR	3 277 209	3 331 520	4,08
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.32	400 000	EUR	412 138	416 328	0,51
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.34	1 600 000	EUR	1 642 606	1 673 296	2,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 07 - 07.04.35	1 600 000	EUR	1 497 663	1 650 688	2,02
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 10 - 07.04.42	2 000 000	EUR	1 972 753	2 025 540	2,48
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 13 - 15.08.23	16 100 000	EUR	16 382 087	16 422 483	20,13
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 00 - 01.04.31	2 400 000	EUR	2 501 556	2 504 784	3,07
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	17 200 000	EUR	19 072 933	17 683 836	21,67
Commerzbank AG 1.625% 13 - 19.10.20	1 000 000	EUR	1 031 680	1 006 130	1,23
Deutsche Kreditbank AG 1.375% 14 - 25.02.21	1 300 000	EUR	1 340 755	1 314 521	1,61
Deutsche Pfandbriefbank AG 1.875% 14 - 21.01.22	1 500 000	EUR	1 544 801	1 552 233	1,90
Deutsche Pfandbriefbank AG 2.375% 13 - 29.05.28	1 200 000	EUR	1 368 708	1 443 532	1,77
DZ HYP AG 3.65% 05 - 28.12.20	1 000 000	EUR	1 072 890	1 019 060	1,25
DZ HYP AG 3.70% 05 - 16.12.20	10 000 000	EUR	10 726 100	10 179 800	12,48
Hamburg Commercial Bank AG 0.75% 14 - 10.07.21	750 000	EUR	756 410	759 339	0,93
HeidelbergCement AG 2.25% 16 - 30.03.23	100 000	EUR	105 526	103 541	0,13
Muenchener Hypothekenbank eG 1.50% 14 - 25.06.24	600 000	EUR	633 240	644 128	0,79
Muenchener Hypothekenbank eG 1.75% 12 - 06.03.22	1 000 000	EUR	1 059 350	1 040 812	1,28
Norddeutsche Landesbank Girozentrale 3.25% 11 - 18.01.21	532 000	EUR	541 934	542 518	0,67
UniCredit Bank AG 1.875% 12 - 09.12.22	400 000	EUR	416 150	419 679	0,51
			78 304 326	76 728 017	94,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Espagne					
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.01.21	900 000	EUR	901 728	902 295	1,10
			901 728	902 295	1,10
Total - Obligations			79 206 054	77 630 312	95,13
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			79 206 054	77 630 312	95,13
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.23	3 000 000	EUR	2 973 856	2 969 160	3,64
			2 973 856	2 969 160	3,64
Total - Obligations			2 973 856	2 969 160	3,64
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			2 973 856	2 969 160	3,64
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			82 179 910	80 599 472	98,77
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				80 902 336	99,15

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Autriche					
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	2 300 000	EUR	4 503 194	5 091 651	2,24
			4 503 194	5 091 651	2,24
Belgique					
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.27	1 100 000	EUR	1 238 601	1 262 694	0,55
Belgium Zero Coupon 10 - 28.09.20	3 900 000	EUR	4 331 873	4 385 892	1,93
			5 570 474	5 648 586	2,48
Canada					
Canada 1.50% 12 - 06.01.23	1 886 000	CAD	1 392 578	1 432 446	0,63
Canada 5.75% 98 - 06.01.29	2 750 000	CAD	2 803 825	2 943 671	1,29
			4 196 403	4 376 117	1,92
France					
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.50% 18 - 16.11.22	1 000 000	EUR	1 141 233	1 132 931	0,50
BNP Paribas SA 2.75% 15 - 27.01.26	500 000	EUR	614 837	606 884	0,27
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.24	3 700 000	EUR	4 210 877	4 251 942	1,87
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.32	3 300 000	EUR	3 574 585	3 698 093	1,63
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.32	600 000	EUR	654 160	669 597	0,29
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.33	5 100 000	EUR	5 501 050	5 671 300	2,49
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.35	1 300 000	EUR	1 366 836	1 411 270	0,62
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.36	5 900 000	EUR	6 076 667	6 363 377	2,80
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.37	1 200 000	EUR	1 224 588	1 282 359	0,56
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.38	43 500 000	EUR	45 856 153	45 858 182	20,16
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.39	2 600 000	EUR	2 505 725	2 717 733	1,19
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.40	400 000	EUR	398 707	412 659	0,18
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.42	4 600 000	EUR	4 334 716	4 594 766	2,02
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.43	5 700 000	EUR	5 280 926	5 627 959	2,47
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.32	1 400 000	EUR	1 493 918	1 564 391	0,69
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.38	300 000	EUR	303 739	315 771	0,14
			84 538 717	86 179 214	37,88
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 05 - 01.04.34	3 400 000	EUR	3 819 761	3 970 046	1,75
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	14 700 000	EUR	17 011 072	16 974 740	7,46
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG FRN 19 - 11.05.79	1 500 000	EUR	1 667 452	1 636 628	0,72
			22 498 285	22 581 414	9,93
Italie					
Assicurazioni Generali SpA FRN 12 - 12.12.42	1 000 000	EUR	1 309 504	1 300 046	0,57
			1 309 504	1 300 046	0,57
Japon					
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 16 - 13.09.21	800 000	USD	807 591	806 499	0,35
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 17 - 25.07.22	858 000	USD	865 186	860 865	0,38
			1 672 777	1 667 364	0,73

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Pays-Bas					
ING Groep NV 0.75% 17 - 03.09.22	1 000 000	EUR	1 140 675	1 131 872	0,50
Volkswagen International Finance NV FRN 17 - 31.12.99	2 300 000	EUR	2 641 755	2 524 702	1,11
			3 782 430	3 656 574	1,61
Espagne					
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 98 - 31.01.23	1 700 000	EUR	1 916 538	1 922 682	0,85
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 01 - 30.07.25	2 300 000	EUR	2 425 232	2 590 607	1,14
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.01.23	3 400 000	EUR	3 883 049	3 845 594	1,69
			8 224 819	8 358 883	3,68
Supranationales					
European Investment Bank 1.00% 16 - 14.04.32	4 700 000	EUR	5 952 338	6 025 916	2,65
			5 952 338	6 025 916	2,65
Suisse					
UBS AG 0.625% 18 - 23.01.23	1 564 000	EUR	1 790 568	1 779 087	0,78
			1 790 568	1 779 087	0,78
Royaume-Uni					
Barclays PLC FRN 16 - 08.10.21	600 000	USD	608 927	609 221	0,27
Barclays PLC 3.20% 16 - 08.10.21	200 000	USD	201 759	204 448	0,09
Barclays PLC 3.684% 17 - 01.10.23	575 000	USD	587 725	596 735	0,26
Barclays PLC 4.375% 16 - 01.12.26	200 000	USD	213 975	225 204	0,10
Barclays PLC FRN 18 - 16.05.29	200 000	USD	223 401	234 328	0,10
United Kingdom Gilt 3.25% 12 - 22.01.44	29 200 000	GBP	56 567 111	56 667 688	24,91
			58 402 898	58 537 624	25,73
États-Unis					
Bank of America Corp. FRN 17 - 24.04.23	116 000	USD	117 082	116 610	0,05
Bank of America Corp. FRN 17 - 20.01.23	128 000	USD	129 457	129 170	0,06
Bank of America Corp. 2.503% 16 - 21.10.22	125 000	USD	125 848	127 969	0,06
Bank of America Corp. 2.625% 15 - 19.10.20	400 000	USD	400 794	402 719	0,18
Bank of America Corp. FRN 17 - 20.01.28	400 000	USD	428 069	454 004	0,20
Bank of America Corp. 4.183% 16 - 25.11.27	300 000	USD	323 210	343 337	0,15
Bank of America Corp. FRN 17 - 20.01.48	125 000	USD	151 393	161 945	0,07
Citigroup Inc. FRN 17 - 17.05.24	627 000	USD	634 336	627 527	0,28
Citigroup Inc. FRN 16 - 09.01.23	804 000	USD	818 477	812 161	0,36
Citigroup Inc. FRN 17 - 24.07.23	200 000	USD	202 463	208 147	0,09
Citigroup Inc. 3.20% 16 - 21.10.26	325 000	USD	336 187	356 241	0,16
Citigroup Inc. FRN 17 - 01.10.28	200 000	USD	214 126	225 440	0,10
Citigroup Inc. FRN 18 - 23.04.29	200 000	USD	218 096	228 175	0,10
Citigroup Inc. FRN 17 - 24.04.48	350 000	USD	415 797	433 385	0,19
Citigroup Inc. 4.50% 11 - 14.01.22	110 000	USD	113 851	116 578	0,05
Citigroup Inc. 8.125% 09 - 15.07.39	300 000	USD	493 492	519 545	0,23
CVS Health Corp. 3.875% 15 - 20.07.25	625 000	USD	662 801	702 403	0,31
Goldman Sachs Group Inc. FRN 13 - 29.11.23	734 000	USD	760 467	745 474	0,33
Intel Corp. FRN 17 - 05.11.22	736 000	USD	738 186	737 860	0,32
Morgan Stanley FRN 17 - 05.08.24	138 000	USD	140 165	139 020	0,06
Morgan Stanley FRN 17 - 20.01.22	101 000	USD	101 739	101 415	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Morgan Stanley FRN 16 - 24.10.23	276 000	USD	281 156	279 342	0,12
Morgan Stanley 3.125% 18 - 23.01.23	225 000	USD	229 780	238 569	0,11
Morgan Stanley FRN 17 - 22.07.28	875 000	USD	930 790	983 919	0,43
Morgan Stanley 3.625% 17 - 20.01.27	125 000	USD	132 724	141 130	0,06
Morgan Stanley 3.875% 16 - 27.01.26	325 000	USD	347 332	367 642	0,16
Morgan Stanley FRN 17 - 22.07.38	450 000	USD	495 994	532 156	0,23
Morgan Stanley 4.10% 13 - 22.05.23	252 000	USD	263 502	272 341	0,12
Morgan Stanley 4.30% 15 - 27.01.45	200 000	USD	234 877	251 702	0,11
Morgan Stanley 5.00% 13 - 24.11.25	242 000	USD	269 569	282 635	0,12
Morgan Stanley 5.50% 10 - 24.07.20	400 000	USD	408 540	401 225	0,18
TFCF America Inc. 3.00% 13 - 15.09.22	775 000	USD	786 137	810 337	0,36
United Technologies Corp. 3.125% 17 - 05.04.27	200 000	USD	208 910	222 252	0,10
United Technologies Corp. 4.125% 18 - 16.11.28	200 000	USD	223 748	235 577	0,10
			12 339 095	12 707 952	5,59
Total - Obligations			214 781 502	217 910 428	95,79
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			214 781 502	217 910 428	95,79
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
France					
BPCE SA 3.25% 18 - 01.11.28	250 000	USD	260 615	272 936	0,12
			260 615	272 936	0,12
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 11.01.24	1 600 000	EUR	1 724 217	1 747 244	0,77
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.21	300 000	EUR	331 597	337 248	0,15
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 09.01.21	2 500 000	EUR	2 822 940	2 810 346	1,23
			4 878 754	4 894 838	2,15
États-Unis					
PNC Bank NA 2.45% 17 - 28.07.22	545 000	USD	553 349	565 547	0,25
			553 349	565 547	0,25
Total - Obligations			5 692 718	5 733 321	2,52
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			5 692 718	5 733 321	2,52
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			220 474 220	223 643 749	98,31
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				224 496 426	98,68

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en GBP)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Belgique					
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.21	100 000	EUR	90 057	91 263	0,09
			90 057	91 263	0,09
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.20	1 100 000	EUR	959 250	1 001 490	0,98
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.24	100 000	EUR	89 624	92 810	0,09
			1 048 874	1 094 300	1,07
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 94 - 01.04.24	100 000	EUR	90 222	93 004	0,09
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 01.04.23	100 000	EUR	87 019	92 405	0,09
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.26	500 000	EUR	429 668	470 239	0,46
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 01.04.26	15 300 000	EUR	14 298 525	14 396 416	14,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.33	3 100 000	EUR	2 565 259	2 942 902	2,88
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 05 - 01.04.34	11 200 000	EUR	10 516 876	10 584 162	10,37
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 07 - 07.04.39	2 700 000	EUR	2 474 641	2 513 424	2,46
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 10 - 07.04.42	10 300 000	EUR	9 094 721	9 482 169	9,29
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	21 000 000	EUR	19 278 873	19 625 783	19,22
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 17 - 15.08.48	22 200 000	EUR	20 417 003	20 341 242	19,93
			79 252 807	80 541 746	78,89
Espagne					
Spain 3.45% 16 - 30.07.66	2 300 000	EUR	3 414 318	3 440 590	3,37
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.10.22	1 700 000	EUR	1 488 979	1 556 550	1,52
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 15 - 30.07.20	1 300 000	EUR	1 106 428	1 182 055	1,16
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 15 - 30.07.21	500 000	EUR	417 981	456 350	0,45
			6 427 706	6 635 545	6,50
Supranationales					
European Investment Bank 1.00% 16 - 14.04.32	1 600 000	EUR	1 613 700	1 660 225	1,63
European Investment Bank 5.625% 00 - 06.07.32	700 000	GBP	1 048 866	1 094 478	1,07
			2 662 566	2 754 703	2,70

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en GBP)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis					
Becton Dickinson and Co. 1.401% 18 - 24.05.23	950 000	EUR	889 572	877 021	0,86
			889 572	877 021	0,86
Total - Obligations			90 371 582	91 994 578	90,11
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			90 371 582	91 994 578	90,11
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 11.01.21	5 100 000	EUR	4 455 348	4 632 656	4,54
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.20	1 000 000	EUR	880 750	909 137	0,89
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 10 - 03.01.25	4 600 000	EUR	3 865 833	4 057 633	3,97
			9 201 931	9 599 426	9,40
Total - Obligations			9 201 931	9 599 426	9,40
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			9 201 931	9 599 426	9,40
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			99 573 513	101 594 004	99,51
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				101 667 374	99,58

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Australie					
Australia 0.25% 20 - 21.11.24	2 460 000	AUD	1 467 450	1 500 128	0,06
Australia 1.00% 20 - 21.12.30	2 600 000	AUD	1 562 819	1 604 420	0,06
Australia 1.25% 20 - 21.05.32	1 954 000	AUD	1 205 482	1 232 926	0,05
Australia 1.50% 19 - 21.06.31	2 130 000	AUD	1 352 124	1 380 393	0,05
Australia 2.00% 17 - 21.12.21	2 150 000	AUD	1 351 282	1 351 707	0,05
Australia 2.25% 16 - 21.05.28	3 753 000	AUD	2 467 533	2 569 078	0,10
Australia 2.25% 17 - 21.11.22	3 096 000	AUD	1 952 105	1 987 509	0,08
Australia 2.50% 18 - 21.05.30	3 542 000	AUD	2 366 415	2 503 675	0,10
Australia 2.75% 12 - 21.04.24	3 896 000	AUD	2 606 748	2 607 929	0,10
Australia 2.75% 15 - 21.06.35	998 000	AUD	648 318	740 636	0,03
Australia 2.75% 16 - 21.11.27	3 263 000	AUD	2 157 549	2 300 902	0,09
Australia 2.75% 17 - 21.11.28	3 179 000	AUD	2 145 973	2 261 137	0,09
Australia 2.75% 18 - 21.11.29	3 294 000	AUD	2 237 438	2 364 015	0,09
Australia 2.75% 18 - 21.05.41	834 000	AUD	602 004	612 292	0,02
Australia 3.00% 16 - 21.03.47	1 652 000	AUD	1 178 059	1 283 715	0,05
Australia 3.25% 12 - 21.04.29	3 620 000	AUD	2 492 914	2 678 551	0,11
Australia 3.25% 13 - 21.04.25	3 417 000	AUD	2 311 105	2 377 635	0,09
Australia 3.25% 15 - 21.06.39	1 314 000	AUD	942 401	1 033 326	0,04
Australia 3.75% 14 - 21.04.37	1 330 000	AUD	1 045 483	1 103 876	0,04
Australia 4.25% 14 - 21.04.26	4 034 000	AUD	2 903 779	3 003 083	0,12
Australia 4.50% 13 - 21.04.33	1 751 000	AUD	1 386 035	1 521 501	0,06
Australia 4.75% 11 - 21.04.27	3 672 000	AUD	2 749 339	2 873 987	0,11
Australia 5.50% 11 - 21.04.23	3 632 000	AUD	2 489 657	2 551 973	0,10
Australia 5.75% 10 - 15.07.22	2 930 000	AUD	2 058 408	1 996 021	0,08
			43 680 420	45 440 415	1,77
Autriche					
Austria Zero Coupon 16 - 15.07.23	1 182 000	EUR	1 196 657	1 202 685	0,05
Austria Zero Coupon 17 - 20.09.22	1 012 000	EUR	1 021 234	1 025 460	0,04
Austria Zero Coupon 19 - 15.07.24	770 000	EUR	787 604	787 687	0,03
Austria Zero Coupon 20 - 20.02.30	661 000	EUR	677 901	676 534	0,03
Austria Zero Coupon 20 - 20.04.23	621 000	EUR	631 435	631 309	0,02
Austria 0.50% 17 - 20.04.27	1 182 000	EUR	1 213 228	1 255 757	0,05
Austria 0.50% 19 - 20.02.29	1 339 000	EUR	1 399 988	1 431 391	0,06
Austria 0.75% 16 - 20.10.26	1 540 000	EUR	1 605 583	1 657 086	0,06
Austria 0.75% 18 - 20.02.28	1 250 000	EUR	1 300 160	1 355 875	0,05
Austria 0.75% 20 - 20.03.51	350 000	EUR	392 185	394 415	0,01
Austria 1.20% 15 - 20.10.25	1 350 000	EUR	1 455 454	1 474 605	0,06
Austria 1.50% 16 - 20.02.47	901 000	EUR	1 035 118	1 188 410	0,05
Austria 1.50% 16 - 11.02.86	308 000	EUR	368 500	469 823	0,02
Austria 1.65% 14 - 21.10.24	1 219 000	EUR	1 316 335	1 336 999	0,05
Austria 1.75% 13 - 20.10.23	1 412 000	EUR	1 500 901	1 522 277	0,06
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	742 000	EUR	1 144 415	1 457 807	0,06
Austria 2.40% 13 - 23.05.34	972 000	EUR	1 217 133	1 299 467	0,05
Austria 3.15% 12 - 20.06.44	891 000	EUR	1 416 871	1 508 374	0,06
Austria 3.40% 12 - 22.11.22	1 300 000	EUR	1 419 025	1 425 320	0,06
Austria 3.50% 06 - 15.09.21	1 950 000	EUR	2 046 217	2 045 569	0,08
Austria 3.65% 11 - 20.04.22	1 068 000	EUR	1 148 321	1 150 236	0,04
Austria 3.80% 12 - 26.01.62	462 000	EUR	932 612	1 062 554	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Autriche (suite)					
Austria 4.15% 07 - 15.03.37	1 740 000	EUR	2 684 287	2 924 592	0,11
Austria 4.85% 09 - 15.03.26	1 141 000	EUR	1 454 736	1 493 911	0,06
Austria 6.25% 97 - 15.07.27	1 191 000	EUR	1 705 164	1 754 986	0,07
			31 071 064	32 533 129	1,27
Belgique					
Belgium Zero Coupon 20 - 22.10.27	990 000	EUR	1 006 285	1 011 384	0,04
Belgium 0.10% 20 - 22.06.30	1 079 000	EUR	1 097 024	1 106 083	0,04
Belgium 0.20% 16 - 22.10.23	1 175 000	EUR	1 189 051	1 205 198	0,05
Belgium 0.40% 20 - 22.06.40	633 000	EUR	632 749	633 506	0,02
Belgium 0.50% 17 - 22.10.24	1 434 237	EUR	1 477 358	1 497 487	0,06
Belgium 0.80% 15 - 22.06.25	1 890 000	EUR	1 956 401	2 012 472	0,08
Belgium 0.80% 17 - 22.06.27	1 755 000	EUR	1 852 776	1 894 698	0,07
Belgium 0.80% 18 - 22.06.28	1 874 000	EUR	1 916 919	2 038 387	0,08
Belgium 0.90% 19 - 22.06.29	1 900 000	EUR	2 022 170	2 093 040	0,08
Belgium 1.00% 15 - 22.06.31	1 681 000	EUR	1 792 789	1 878 854	0,07
Belgium 1.00% 16 - 22.06.26	1 903 000	EUR	2 004 448	2 064 565	0,08
Belgium 1.25% 18 - 22.04.33	870 000	EUR	973 991	1 007 634	0,04
Belgium 1.45% 17 - 22.06.37	548 000	EUR	621 825	656 394	0,03
Belgium 1.60% 16 - 22.06.47	1 368 000	EUR	1 520 942	1 725 595	0,07
Belgium 1.70% 19 - 22.06.50	920 000	EUR	1 072 495	1 199 358	0,05
Belgium 1.90% 15 - 22.06.38	1 064 000	EUR	1 254 521	1 362 239	0,05
Belgium 2.15% 16 - 22.06.66	820 000	EUR	1 174 884	1 290 188	0,05
Belgium 2.25% 13 - 22.06.23	1 542 000	EUR	1 660 697	1 673 378	0,06
Belgium 2.25% 17 - 22.06.57	660 000	EUR	824 090	1 005 246	0,04
Belgium 2.60% 14 - 22.06.24	1 831 000	EUR	2 041 877	2 061 889	0,08
Belgium 3.00% 14 - 22.06.34	944 000	EUR	1 213 434	1 325 376	0,05
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	1 209 000	EUR	1 922 245	2 131 467	0,08
Belgium 4.00% 06 - 28.03.22	1 684 000	EUR	1 814 550	1 820 320	0,07
Belgium 4.00% 12 - 28.03.32	1 061 000	EUR	1 478 621	1 563 702	0,06
Belgium 4.25% 10 - 28.03.41	2 138 000	EUR	3 400 588	3 771 218	0,15
Belgium 4.25% 11 - 28.09.21	1 870 000	EUR	1 981 790	1 982 761	0,08
Belgium 4.25% 12 - 28.09.22	1 990 000	EUR	2 197 020	2 208 839	0,09
Belgium 4.50% 11 - 28.03.26	1 329 000	EUR	1 678 342	1 708 961	0,07
Belgium 5.00% 04 - 28.03.35	2 424 000	EUR	3 878 244	4 142 398	0,16
Belgium 5.50% 98 - 28.03.28	2 385 000	EUR	3 385 916	3 467 552	0,14
			51 044 042	53 540 189	2,09
Canada					
Canada 0.50% 16 - 03.01.22	2 262 000	CAD	1 513 726	1 484 991	0,06
Canada 0.50% 20 - 09.01.25	1 782 000	CAD	1 175 563	1 170 887	0,05
Canada 0.75% 16 - 09.01.21	2 428 000	CAD	1 607 052	1 595 287	0,06
Canada 1.00% 16 - 06.01.27	1 705 000	CAD	1 087 648	1 159 069	0,04
Canada 1.00% 17 - 09.01.22	3 388 000	CAD	2 233 480	2 247 149	0,09
Canada 1.25% 19 - 06.01.30	2 396 000	CAD	1 648 461	1 674 943	0,07
Canada 1.25% 19 - 11.01.21	1 054 000	CAD	713 678	697 396	0,03
Canada 1.25% 19 - 03.01.25	1 868 000	CAD	1 273 190	1 270 122	0,05
Canada 1.50% 12 - 06.01.23	1 769 000	CAD	1 203 646	1 197 535	0,05
Canada 1.50% 15 - 06.01.26	1 682 000	CAD	1 130 841	1 172 198	0,05
Canada 1.50% 19 - 09.01.24	1 710 000	CAD	1 163 426	1 171 556	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Canada (suite)					
Canada 1.50% 19 - 08.01.21	1 262 000	CAD	856 482	836 358	0,03
Canada 1.50% 19 - 02.01.22	1 000 000	CAD	681 134	666 052	0,03
Canada 1.50% 20 - 05.01.22	2 095 000	CAD	1 399 431	1 399 433	0,05
Canada 1.75% 17 - 03.01.23	2 530 000	CAD	1 685 911	1 718 322	0,07
Canada 2.00% 17 - 06.01.28	1 510 000	CAD	1 055 200	1 106 413	0,04
Canada 2.00% 17 - 12.01.51	1 695 000	CAD	1 280 016	1 409 181	0,05
Canada 2.00% 18 - 09.01.23	1 624 000	CAD	1 071 467	1 117 732	0,04
Canada 2.25% 14 - 06.01.25	1 760 000	CAD	1 237 785	1 257 851	0,05
Canada 2.25% 18 - 06.01.29	1 320 000	CAD	917 320	991 762	0,04
Canada 2.25% 18 - 03.01.24	1 846 000	CAD	1 258 587	1 291 993	0,05
Canada 2.50% 13 - 06.01.24	1 660 000	CAD	1 158 337	1 177 853	0,05
Canada 2.75% 11 - 06.01.22	1 618 000	CAD	1 116 563	1 108 568	0,04
Canada 2.75% 14 - 12.01.64	603 000	CAD	540 836	646 684	0,02
Canada 2.75% 14 - 12.01.48	1 760 000	CAD	1 405 167	1 651 344	0,06
Canada 3.25% 10 - 06.01.21	1 177 000	CAD	788 093	790 653	0,03
Canada 3.50% 11 - 12.01.45	1 888 000	CAD	1 686 000	1 928 346	0,08
Canada 4.00% 08 - 06.01.41	1 485 000	CAD	1 367 950	1 533 275	0,06
Canada 5.00% 04 - 06.01.37	1 294 000	CAD	1 252 082	1 403 214	0,05
Canada 5.75% 98 - 06.01.29	1 310 000	CAD	1 186 484	1 247 502	0,05
Canada 5.75% 01 - 06.01.33	1 403 000	CAD	1 397 055	1 491 047	0,06
Canada 8.00% 96 - 06.01.27	251 000	CAD	247 188	248 537	0,01
			38 339 799	39 863 253	1,56
Danemark					
Denmark 0.25% 19 - 15.11.22	3 541 000	DKK	483 567	484 094	0,02
Denmark 0.50% 17 - 15.11.27	10 729 000	DKK	1 487 668	1 537 698	0,06
Denmark 0.50% 19 - 15.11.29	8 942 000	DKK	1 294 804	1 295 583	0,05
Denmark 1.50% 12 - 15.11.23	7 288 000	DKK	1 038 695	1 045 408	0,04
Denmark 1.75% 14 - 15.11.25	7 820 000	DKK	1 158 832	1 178 272	0,05
Denmark 3.00% 11 - 15.11.21	7 932 000	DKK	1 116 380	1 116 287	0,04
Denmark 4.50% 08 - 15.11.39	16 182 000	DKK	3 816 403	4 079 279	0,16
			10 396 349	10 736 621	0,42
Finlande					
Finland Zero Coupon 16 - 15.09.23	800 000	EUR	806 328	815 600	0,03
Finland Zero Coupon 17 - 15.04.22	510 000	EUR	514 059	515 508	0,02
Finland Zero Coupon 19 - 15.09.24	420 000	EUR	430 143	430 256	0,02
Finland 0.125% 20 - 15.04.36	384 000	EUR	394 090	388 451	0,01
Finland 0.50% 16 - 15.04.26	895 000	EUR	923 439	946 516	0,04
Finland 0.50% 17 - 15.09.27	890 000	EUR	921 121	947 708	0,04
Finland 0.50% 18 - 15.09.28	500 000	EUR	501 702	534 630	0,02
Finland 0.50% 19 - 15.09.29	780 000	EUR	815 381	835 848	0,03
Finland 0.75% 15 - 15.04.31	610 000	EUR	633 038	671 720	0,03
Finland 0.875% 15 - 15.09.25	519 000	EUR	551 259	557 515	0,02
Finland 1.125% 18 - 15.04.34	560 000	EUR	607 650	649 018	0,03
Finland 1.375% 17 - 15.04.47	430 000	EUR	514 464	564 895	0,02
Finland 1.50% 13 - 15.04.23	500 000	EUR	527 418	529 670	0,02
Finland 1.625% 12 - 15.09.22	826 000	EUR	865 650	867 267	0,03
Finland 2.00% 14 - 15.04.24	612 000	EUR	666 122	673 212	0,03
Finland 2.625% 12 - 07.04.42	550 000	EUR	773 405	852 131	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Finlande (suite)					
Finland 2.75% 12 - 07.04.28	744 000	EUR	900 330	930 804	0,04
Finland 4.00% 09 - 07.04.25	800 000	EUR	970 084	986 168	0,04
			12 315 683	12 696 917	0,50
France					
France OAT Zero Coupon 16 - 25.05.22	3 915 000	EUR	3 949 586	3 960 023	0,15
France OAT Zero Coupon 17 - 25.03.23	4 925 000	EUR	4 994 299	5 008 232	0,20
France OAT Zero Coupon 18 - 25.03.24	4 593 000	EUR	4 658 942	4 692 668	0,18
France OAT Zero Coupon 19 - 25.02.22	3 518 000	EUR	3 550 067	3 553 180	0,14
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	4 670 000	EUR	4 765 797	4 788 618	0,19
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	5 060 000	EUR	5 125 555	5 155 634	0,20
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.23	1 325 000	EUR	1 345 383	1 346 068	0,05
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	1 090 000	EUR	1 111 588	1 118 013	0,04
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	4 567 000	EUR	4 605 076	4 764 751	0,19
France OAT 0.50% 15 - 25.05.25	4 784 000	EUR	4 943 267	5 028 941	0,20
France OAT 0.50% 16 - 25.05.26	4 397 000	EUR	4 539 548	4 651 586	0,18
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	4 016 000	EUR	4 159 855	4 285 474	0,17
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	4 818 000	EUR	5 078 773	5 229 939	0,20
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	4 968 000	EUR	5 198 283	5 404 687	0,21
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	1 059 000	EUR	1 120 911	1 105 808	0,04
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	4 415 000	EUR	4 649 838	4 777 471	0,19
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	4 155 000	EUR	4 422 962	4 552 634	0,18
France OAT 1.25% 16 - 25.05.36	4 127 000	EUR	4 553 572	4 824 463	0,19
France OAT 1.25% 18 - 25.05.34	3 881 000	EUR	4 333 635	4 509 722	0,18
France OAT 1.50% 15 - 25.05.31	5 616 000	EUR	6 207 209	6 609 470	0,26
France OAT 1.50% 19 - 25.05.50	3 276 000	EUR	3 894 645	4 128 743	0,16
France OAT 1.75% 13 - 25.05.23	5 223 000	EUR	5 511 070	5 582 342	0,22
France OAT 1.75% 14 - 25.11.24	4 577 000	EUR	4 939 334	5 047 058	0,20
France OAT 1.75% 16 - 25.05.66	1 619 000	EUR	1 973 053	2 309 665	0,09
France OAT 1.75% 17 - 25.06.39	3 103 000	EUR	3 692 365	3 951 671	0,15
France OAT 2.00% 17 - 25.05.48	3 347 000	EUR	4 089 041	4 640 281	0,18
France OAT 2.25% 12 - 25.10.22	4 772 000	EUR	5 062 259	5 090 292	0,20
France OAT 2.25% 13 - 25.05.24	4 334 000	EUR	4 770 310	4 816 808	0,19
France OAT 2.50% 14 - 25.05.30	5 150 000	EUR	6 230 401	6 529 170	0,25
France OAT 2.75% 12 - 25.10.27	5 375 066	EUR	6 359 117	6 621 006	0,26
France OAT 3.00% 12 - 25.04.22	5 748 041	EUR	6 107 432	6 126 837	0,24
France OAT 3.25% 11 - 25.10.21	4 506 000	EUR	4 731 863	4 734 905	0,18
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	3 149 000	EUR	4 657 617	5 220 097	0,20
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	5 137 000	EUR	6 225 474	6 341 626	0,25
France OAT 4.00% 05 - 25.04.55	2 051 000	EUR	3 653 721	4 239 827	0,17
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	3 287 000	EUR	5 088 997	5 509 012	0,21
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	1 875 000	EUR	3 574 928	4 087 125	0,16
France OAT 4.25% 07 - 25.10.23	3 205 000	EUR	3 653 838	3 727 415	0,14
France OAT 4.25% 07 - 25.10.23	2 218 000	EUR	2 565 972	2 579 534	0,10
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	4 478 000	EUR	7 517 828	8 235 938	0,32
France OAT 4.75% 04 - 25.04.35	3 593 000	EUR	5 668 237	6 063 906	0,24
France OAT 5.50% 98 - 25.04.29	4 666 000	EUR	6 787 540	7 074 123	0,28
France OAT 5.75% 01 - 25.10.32	3 983 000	EUR	6 395 091	6 841 599	0,27

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
France OAT 6.00% 94 - 25.10.25	3 821 000	EUR	5 060 330	5 164 081	0,20
France OAT 8.50% 92 - 25.04.23	1 230 000	EUR	1 542 853	1 548 201	0,06
			203 067 462	211 578 644	8,26
Allemagne					
Bundesobligation Zero Coupon 16 - 10.08.21	2 432 000	EUR	2 451 672	2 451 918	0,10
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 04.08.22	2 070 000	EUR	2 096 032	2 095 150	0,08
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 10.07.22	2 411 000	EUR	2 443 297	2 449 431	0,10
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 14.04.23	2 843 000	EUR	2 884 164	2 900 429	0,11
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 13.10.23	2 425 000	EUR	2 459 345	2 483 079	0,10
Bundesobligation Zero Coupon 19 - 04.05.24	2 982 000	EUR	3 048 214	3 063 319	0,12
Bundesobligation Zero Coupon 19 - 18.10.24	2 619 000	EUR	2 697 533	2 699 849	0,10
Bundesobligation Zero Coupon 20 - 04.11.25	2 020 000	EUR	2 095 062	2 089 246	0,08
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	3 369 000	EUR	3 420 438	3 513 564	0,14
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	3 128 000	EUR	3 257 608	3 285 933	0,13
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	1 005 000	EUR	1 012 434	1 010 005	0,04
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	3 091 000	EUR	3 248 756	3 243 881	0,13
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	930 000	EUR	963 539	966 605	0,04
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	490 000	EUR	510 555	512 413	0,02
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	3 930 000	EUR	4 113 438	4 174 171	0,16
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	3 203 000	EUR	3 360 815	3 430 125	0,13
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	3 283 000	EUR	3 447 211	3 521 444	0,14
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	3 449 000	EUR	3 598 186	3 647 042	0,14
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	3 825 000	EUR	4 006 172	4 088 351	0,16
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	3 543 000	EUR	3 707 276	3 837 565	0,15
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	3 490 000	EUR	3 662 683	3 795 270	0,15
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 14 - 15.08.24	2 787 000	EUR	2 969 015	2 987 441	0,12
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	3 405 000	EUR	3 674 564	3 709 169	0,14
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	2 750 000	EUR	3 475 041	3 754 190	0,15
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 12 - 09.04.22	2 380 000	EUR	2 483 808	2 495 716	0,10
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 13 - 15.02.23	2 424 000	EUR	2 552 312	2 567 040	0,10
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 13 - 15.05.23	2 781 000	EUR	2 958 463	2 960 374	0,11
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 14 - 15.05.24	2 723 000	EUR	2 922 972	2 960 936	0,12
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 12 - 07.04.22	3 170 000	EUR	3 323 661	3 326 154	0,13
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 14 - 15.02.24	2 747 000	EUR	2 973 212	2 997 059	0,12
Bundesrepublik Deutschland 2.00% 11 - 01.04.22	2 785 000	EUR	2 895 949	2 899 658	0,11
Bundesrepublik Deutschland 2.00% 13 - 15.08.23	2 786 000	EUR	3 020 904	3 026 097	0,12
Bundesrepublik Deutschland 2.25% 11 - 09.04.21	2 019 000	EUR	2 086 603	2 087 989	0,08
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 07.04.44	3 477 000	EUR	5 187 683	5 695 083	0,22
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	3 781 000	EUR	5 816 312	6 351 967	0,25
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 07.04.42	2 409 000	EUR	4 006 334	4 248 946	0,17
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 11 - 07.04.21	2 310 000	EUR	2 400 509	2 400 113	0,09
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 01.04.37	3 354 000	EUR	5 524 054	5 772 905	0,22

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 07.04.39	2 284 000	EUR	4 032 831	4 263 703	0,17
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 07.04.28	1 653 000	EUR	2 305 110	2 374 171	0,09
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 07.04.34	3 027 000	EUR	5 022 784	5 253 722	0,20
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 07.04.40	2 535 000	EUR	4 866 805	5 099 558	0,20
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 01.04.31	2 760 000	EUR	4 452 995	4 531 368	0,18
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 01.04.28	1 815 000	EUR	2 583 663	2 680 392	0,10
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 94 - 01.04.24	1 490 000	EUR	1 857 143	1 858 164	0,07
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 01.04.30	1 500 000	EUR	2 391 891	2 491 815	0,10
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 07.04.27	1 800 000	EUR	2 718 973	2 717 352	0,11
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 06.11.21	1 460 000	EUR	1 471 155	1 468 964	0,06
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 09.10.21	1 660 000	EUR	1 674 811	1 672 848	0,06
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 12.10.21	1 947 000	EUR	1 966 287	1 966 178	0,08
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 03.11.22	2 378 000	EUR	2 409 323	2 405 299	0,09
			154 509 597	158 283 161	6,18
Irlande					
Ireland Zero Coupon 17 - 18.10.22	810 000	EUR	815 399	819 534	0,03
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	754 000	EUR	767 551	776 318	0,03
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	590 000	EUR	601 448	603 511	0,02
Ireland 0.80% 15 - 15.03.22	712 000	EUR	727 243	727 949	0,03
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	1 086 000	EUR	1 113 529	1 178 853	0,05
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	1 381 000	EUR	1 451 538	1 488 442	0,06
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	1 106 000	EUR	1 181 456	1 224 232	0,05
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	464 000	EUR	492 363	533 878	0,02
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	700 000	EUR	787 326	800 450	0,03
Ireland 1.50% 19 - 15.05.50	590 000	EUR	650 395	728 709	0,03
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	622 000	EUR	678 365	763 505	0,03
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	1 089 000	EUR	1 238 118	1 473 308	0,06
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	1 140 000	EUR	1 329 451	1 415 994	0,05
Ireland 3.40% 14 - 18.03.24	908 000	EUR	1 025 773	1 038 752	0,04
Ireland 3.90% 13 - 20.03.23	860 000	EUR	953 795	963 888	0,04
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	1 406 000	EUR	1 752 612	1 793 634	0,07
			15 566 362	16 330 957	0,64
Israël					
Israel Government Bond - Fixed 0.75% 19 - 31.07.22	1 000 000	ILS	267 647	260 811	0,01
Israel Government Bond - Fixed 1.00% 19 - 31.03.30	782 000	ILS	209 090	208 298	0,01
Israel Government Bond - Fixed 1.75% 15 - 31.08.25	1 950 000	ILS	553 059	538 711	0,02
Israel Government Bond - Fixed 2.00% 16 - 31.03.27	600 000	ILS	171 969	170 610	0,01
Israel Government Bond - Fixed 2.25% 18 - 28.09.28	2 036 000	ILS	609 532	596 435	0,02
Israel Government Bond - Fixed 3.75% 14 - 31.03.24	3 846 000	ILS	1 145 686	1 120 062	0,04
Israel Government Bond - Fixed 3.75% 17 - 31.03.47	2 018 000	ILS	761 924	767 114	0,03
Israel Government Bond - Fixed 4.25% 12 - 31.03.23	4 098 000	ILS	1 201 364	1 172 845	0,05
Israel Government Bond - Fixed 5.50% 11 - 31.01.22	2 189 000	ILS	632 592	611 929	0,02
Israel Government Bond - Fixed 5.50% 12 - 31.01.42	2 443 000	ILS	1 124 936	1 120 103	0,04
Israel Government Bond - Fixed 6.25% 06 - 30.10.26	3 539 000	ILS	1 291 138	1 244 370	0,05
			7 968 937	7 811 288	0,30
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.05% 19 - 15.01.23	1 901 000	EUR	1 884 315	1 894 391	0,07
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 16 - 11.01.21	2 128 000	EUR	2 122 081	2 140 034	0,08

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 19 - 02.01.25	2 411 000	EUR	2 359 906	2 384 336	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.45% 16 - 06.01.21	1 800 000	EUR	1 797 627	1 809 216	0,07
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.60% 20 - 15.06.23	1 665 000	EUR	1 661 165	1 682 030	0,07
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.65% 16 - 15.10.23	2 130 000	EUR	2 090 096	2 154 062	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.85% 19 - 15.01.27	2 000 000	EUR	1 968 536	1 992 436	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.90% 17 - 08.01.22	2 245 000	EUR	2 252 958	2 282 135	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 16 - 15.03.23	1 830 000	EUR	1 834 009	1 865 321	0,07
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 18 - 03.01.23	2 061 000	EUR	2 056 843	2 100 769	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 20 - 08.01.30	1 423 000	EUR	1 332 235	1 383 014	0,05
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	1 718 000	EUR	1 723 593	1 749 897	0,07
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.20% 17 - 04.01.22	2 119 000	EUR	2 131 245	2 160 287	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.25% 16 - 12.01.26	2 328 000	EUR	2 292 461	2 383 148	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 15 - 15.04.22	2 201 000	EUR	2 207 692	2 250 462	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 19 - 04.01.30	2 601 000	EUR	2 611 211	2 633 954	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 15 - 15.09.22	2 033 000	EUR	2 055 036	2 091 396	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 17 - 15.11.24	2 155 000	EUR	2 169 575	2 237 647	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 18 - 15.05.25	1 896 000	EUR	1 908 066	1 966 602	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 20 - 03.01.36	1 397 000	EUR	1 324 536	1 354 873	0,05
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.50% 15 - 06.01.25	2 450 000	EUR	2 449 480	2 549 040	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.60% 16 - 06.01.26	2 426 000	EUR	2 399 598	2 536 910	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.65% 15 - 03.01.32	2 788 000	EUR	2 725 236	2 865 649	0,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.75% 19 - 07.01.24	2 068 000	EUR	2 141 159	2 168 720	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.85% 17 - 15.05.24	1 715 000	EUR	1 746 585	1 805 690	0,07
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.85% 20 - 07.01.25	1 288 000	EUR	1 328 400	1 359 204	0,05
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 15 - 12.01.25	2 363 000	EUR	2 418 779	2 521 439	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 18 - 02.01.28	2 851 000	EUR	2 946 397	3 052 677	0,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.05% 17 - 08.01.27	2 377 000	EUR	2 390 501	2 549 611	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.10% 19 - 15.07.26	2 150 000	EUR	2 235 778	2 306 482	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.15% 14 - 15.12.21	2 000 000	EUR	2 044 700	2 064 381	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.20% 17 - 06.01.27	2 140 000	EUR	2 182 847	2 317 111	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.25% 16 - 09.01.36	1 791 000	EUR	1 745 691	1 927 989	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.30% 18 - 15.10.21	2 020 000	EUR	2 067 812	2 082 071	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 17 - 09.01.33	1 874 000	EUR	1 896 823	2 076 033	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 18 - 10.01.23	2 087 000	EUR	2 175 053	2 230 245	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 20 - 09.01.50	1 604 000	EUR	1 674 254	1 686 864	0,07
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.50% 14 - 12.01.24	2 494 000	EUR	2 604 126	2 700 232	0,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.50% 18 - 15.11.25	2 049 000	EUR	2 121 247	2 237 956	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.70% 16 - 03.01.47	2 135 000	EUR	2 142 438	2 375 461	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.80% 16 - 03.01.67	1 216 000	EUR	1 214 330	1 354 134	0,05
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.80% 18 - 12.01.28	2 343 000	EUR	2 443 943	2 663 349	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.95% 18 - 09.01.38	1 925 000	EUR	1 977 031	2 246 918	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.00% 19 - 08.01.29	2 508 000	EUR	2 789 428	2 906 225	0,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.10% 19 - 03.01.40	1 301 000	EUR	1 497 017	1 548 203	0,06
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.25% 15 - 09.01.46	2 088 000	EUR	2 262 418	2 546 009	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.35% 19 - 03.01.35	1 835 000	EUR	2 043 316	2 235 946	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	2 021 000	EUR	2 204 903	2 555 808	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.50% 14 - 03.01.30	3 161 000	EUR	3 587 338	3 813 680	0,15
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.75% 06 - 08.01.21	3 405 000	EUR	3 524 236	3 547 230	0,14

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.75% 14 - 09.01.24	2 453 000	EUR	2 695 664	2 773 795	0,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.85% 19 - 09.01.49	1 613 000	EUR	2 040 211	2 183 167	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.00% 05 - 02.01.37	3 493 000	EUR	4 111 791	4 586 998	0,18
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 10 - 03.01.26	2 783 000	EUR	3 288 592	3 354 441	0,13
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 05.01.23	2 554 000	EUR	2 817 666	2 859 609	0,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 03.01.24	2 876 000	EUR	3 251 427	3 299 650	0,13
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 08 - 08.01.23	3 156 000	EUR	3 479 782	3 586 172	0,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 11 - 09.01.21	2 849 000	EUR	3 000 221	3 010 019	0,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 13 - 09.01.28	2 906 000	EUR	3 487 453	3 737 555	0,15
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 13 - 09.01.44	2 179 000	EUR	2 968 560	3 267 034	0,13
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 03 - 08.01.34	3 107 000	EUR	4 066 857	4 412 871	0,17
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 07 - 08.01.39	2 712 000	EUR	3 779 569	4 051 646	0,16
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 09 - 03.01.25	2 943 000	EUR	3 432 723	3 533 169	0,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 09 - 09.01.40	2 739 000	EUR	3 625 112	4 112 408	0,16
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 11 - 03.01.22	2 647 000	EUR	2 840 946	2 866 961	0,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.25% 98 - 11.01.29	3 567 000	EUR	4 461 851	4 841 745	0,19
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.50% 12 - 09.01.22	2 317 000	EUR	2 543 673	2 586 421	0,10
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.50% 12 - 11.01.22	2 727 000	EUR	3 047 167	3 063 609	0,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.75% 02 - 02.01.33	2 584 000	EUR	3 548 803	3 829 723	0,15
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.00% 00 - 05.01.31	3 780 000	EUR	5 094 771	5 533 973	0,22
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.50% 97 - 11.01.27	3 311 000	EUR	4 420 790	4 577 123	0,18
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 7.25% 97 - 11.01.26	1 540 000	EUR	2 052 176	2 142 626	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9.00% 93 - 11.01.23	1 556 000	EUR	1 966 475	2 001 153	0,08
			182 786 330	191 559 145	7,48
Japon					
Japan Government Five Year Bond 0.10% 16 - 20.06.21	130 300 000	JPY	1 058 042	1 078 211	0,04
Japan Government Five Year Bond 0.10% 16 - 20.09.21	179 450 000	JPY	1 433 852	1 485 792	0,06
Japan Government Five Year Bond 0.10% 16 - 20.12.21	132 950 000	JPY	1 060 608	1 101 456	0,04
Japan Government Five Year Bond 0.10% 17 - 20.03.22	161 650 000	JPY	1 320 278	1 339 748	0,05
Japan Government Five Year Bond 0.10% 17 - 20.06.22	166 250 000	JPY	1 326 120	1 378 627	0,05
Japan Government Five Year Bond 0.10% 17 - 20.09.22	200 750 000	JPY	1 633 698	1 665 960	0,07
Japan Government Five Year Bond 0.10% 17 - 20.12.22	189 750 000	JPY	1 508 683	1 575 505	0,06
Japan Government Five Year Bond 0.10% 18 - 20.03.23	258 700 000	JPY	2 067 939	2 149 090	0,08
Japan Government Five Year Bond 0.10% 18 - 20.06.23	133 300 000	JPY	1 095 591	1 107 920	0,04
Japan Government Five Year Bond 0.10% 18 - 20.09.23	160 650 000	JPY	1 348 246	1 335 941	0,05
Japan Government Five Year Bond 0.10% 19 - 20.06.24	350 000 000	JPY	3 017 042	2 914 995	0,11

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Five Year Bond 0.10% 19 - 20.09.24	325 200 000	JPY	2 725 600	2 709 413	0,11
Japan Government Five Year Bond 0.10% 20 - 20.12.24	489 700 000	JPY	4 171 164	4 081 202	0,16
Japan Government Five Year Bond 0.10% 20 - 20.03.25	413 700 000	JPY	3 540 267	3 447 061	0,13
Japan Government Five Year Bond 0.10% 19 - 20.12.23	261 300 000	JPY	2 128 783	2 174 053	0,08
Japan Government Five Year Bond 0.10% 19 - 20.03.24	206 900 000	JPY	1 723 887	1 722 308	0,07
Japan Government Forty Year Bond 0.40% 16 - 20.03.56	259 250 000	JPY	1 970 200	1 996 189	0,08
Japan Government Forty Year Bond 0.50% 19 - 20.03.59	313 250 000	JPY	2 724 843	2 481 316	0,10
Japan Government Forty Year Bond 0.80% 18 - 20.03.58	270 250 000	JPY	2 372 359	2 370 449	0,09
Japan Government Forty Year Bond 0.90% 17 - 20.03.57	279 400 000	JPY	2 501 452	2 523 179	0,10
Japan Government Forty Year Bond 1.40% 15 - 20.03.55	137 150 000	JPY	1 450 624	1 413 707	0,06
Japan Government Forty Year Bond 1.70% 14 - 20.03.54	136 100 000	JPY	1 447 035	1 499 738	0,06
Japan Government Forty Year Bond 1.90% 13 - 20.03.53	136 350 000	JPY	1 525 180	1 559 263	0,06
Japan Government Forty Year Bond 2.00% 12 - 20.03.52	219 750 000	JPY	2 505 359	2 546 173	0,10
Japan Government Forty Year Bond 2.20% 09 - 20.03.49	146 100 000	JPY	1 735 324	1 723 620	0,07
Japan Government Forty Year Bond 2.20% 10 - 20.03.50	146 300 000	JPY	1 744 260	1 737 631	0,07
Japan Government Forty Year Bond 2.20% 11 - 20.03.51	215 500 000	JPY	2 560 457	2 577 210	0,10
Japan Government Forty Year Bond 2.40% 07 - 20.03.48	105 000 000	JPY	1 346 572	1 275 526	0,05
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.03.26	102 400 000	JPY	851 092	855 109	0,03
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.06.26	116 950 000	JPY	1 018 938	977 104	0,04
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.09.26	191 050 000	JPY	1 562 419	1 596 737	0,06
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.12.26	253 600 000	JPY	2 041 097	2 120 138	0,08
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 17 - 20.03.27	183 650 000	JPY	1 524 922	1 536 799	0,06
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 17 - 20.06.27	191 500 000	JPY	1 574 242	1 601 841	0,06
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 17 - 20.09.27	170 000 000	JPY	1 372 467	1 422 884	0,06
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 17 - 20.12.27	134 550 000	JPY	1 070 700	1 125 982	0,04
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 18 - 20.03.28	156 900 000	JPY	1 265 691	1 312 720	0,05
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 18 - 20.06.28	179 600 000	JPY	1 464 257	1 502 271	0,06
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 18 - 20.09.28	171 300 000	JPY	1 404 517	1 431 941	0,06
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 19 - 20.12.28	167 100 000	JPY	1 371 240	1 395 812	0,05
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 19 - 20.03.29	269 050 000	JPY	2 266 940	2 245 550	0,09
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 19 - 20.06.29	323 650 000	JPY	2 801 368	2 698 957	0,11

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 19 - 20.09.29	484 600 000	JPY	4 096 880	4 036 219	0,16
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 20 - 20.12.29	598 150 000	JPY	5 142 334	4 975 902	0,19
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 20 - 20.03.30	459 700 000	JPY	3 932 806	3 822 871	0,15
Japan Government Ten Year Bond 0.30% 15 - 20.12.24	108 950 000	JPY	933 059	916 082	0,04
Japan Government Ten Year Bond 0.30% 15 - 20.12.25	110 750 000	JPY	896 194	934 443	0,04
Japan Government Ten Year Bond 0.40% 15 - 20.03.25	134 800 000	JPY	1 138 425	1 139 021	0,04
Japan Government Ten Year Bond 0.40% 15 - 20.06.25	236 450 000	JPY	1 912 228	1 999 865	0,08
Japan Government Ten Year Bond 0.40% 15 - 20.09.25	101 000 000	JPY	836 881	855 713	0,03
Japan Government Ten Year Bond 0.50% 14 - 20.09.24	222 150 000	JPY	1 822 685	1 881 979	0,07
Japan Government Ten Year Bond 0.50% 14 - 20.12.24	67 650 000	JPY	580 111	573 839	0,02
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 13 - 20.03.23	547 150 000	JPY	4 445 864	4 606 912	0,18
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 13 - 20.09.23	79 100 000	JPY	621 745	668 346	0,03
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 13 - 20.12.23	492 400 000	JPY	4 210 341	4 167 707	0,16
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 14 - 20.03.24	216 800 000	JPY	1 767 351	1 838 141	0,07
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 14 - 20.06.24	198 450 000	JPY	1 642 390	1 685 476	0,07
Japan Government Ten Year Bond 0.70% 12 - 20.12.22	264 100 000	JPY	2 162 374	2 225 291	0,09
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 12 - 20.06.22	432 250 000	JPY	3 657 756	3 633 730	0,14
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 12 - 20.09.22	761 800 000	JPY	6 184 705	6 420 076	0,25
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 13 - 20.12.22	572 000 000	JPY	4 829 162	4 831 345	0,19
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 13 - 20.06.23	558 300 000	JPY	4 615 749	4 736 455	0,19
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 13 - 20.09.23	250 650 000	JPY	2 044 363	2 131 220	0,08
Japan Government Ten Year Bond 0.90% 12 - 20.03.22	204 550 000	JPY	1 681 170	1 718 563	0,07
Japan Government Ten Year Bond 0.90% 12 - 20.06.22	254 050 000	JPY	1 960 489	2 139 834	0,08
Japan Government Ten Year Bond 1.00% 11 - 20.09.21	459 900 000	JPY	3 840 079	3 849 660	0,15
Japan Government Ten Year Bond 1.00% 12 - 20.12.21	459 400 000	JPY	3 950 519	3 856 318	0,15
Japan Government Ten Year Bond 1.00% 12 - 20.03.22	485 400 000	JPY	4 096 020	4 085 064	0,16
Japan Government Ten Year Bond 1.10% 11 - 20.06.21	221 150 000	JPY	1 801 288	1 847 701	0,07
Japan Government Ten Year Bond 1.10% 11 - 20.09.21	248 900 000	JPY	1 989 133	2 085 981	0,08
Japan Government Ten Year Bond 1.10% 11 - 20.12.21	289 800 000	JPY	2 380 268	2 436 169	0,10
Japan Government Ten Year Bond 1.20% 11 - 20.06.21	297 150 000	JPY	2 426 067	2 485 057	0,10
Japan Government Thirty Year Bond 0.30% 16 - 20.06.46	166 500 000	JPY	1 241 982	1 298 955	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 19 - 20.06.49	278 700 000	JPY	2 399 750	2 193 332	0,09
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 19 - 20.09.49	291 750 000	JPY	2 429 859	2 292 470	0,09
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 20 - 20.12.49	263 200 000	JPY	2 255 329	2 064 941	0,08
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 20 - 20.03.50	180 000 000	JPY	1 490 389	1 409 921	0,06
Japan Government Thirty Year Bond 0.50% 16 - 20.09.46	226 300 000	JPY	1 831 974	1 854 777	0,07
Japan Government Thirty Year Bond 0.60% 16 - 20.12.46	165 300 000	JPY	1 329 959	1 386 478	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 0.70% 18 - 20.06.48	283 450 000	JPY	2 296 852	2 425 270	0,09
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 16 - 20.03.46	179 650 000	JPY	1 587 277	1 582 039	0,06

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 17 - 20.03.47	158 450 000	JPY	1 414 751	1 390 483	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 17 - 20.06.47	161 900 000	JPY	1 378 249	1 421 533	0,06
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 17 - 20.09.47	183 300 000	JPY	1 513 029	1 610 309	0,06
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 17 - 20.12.47	223 750 000	JPY	1 877 823	1 964 374	0,08
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 18 - 20.03.48	268 500 000	JPY	2 313 629	2 355 543	0,09
Japan Government Thirty Year Bond 0.90% 18 - 20.09.48	188 350 000	JPY	1 653 514	1 688 063	0,07
Japan Government Thirty Year Bond 1.10% 03 - 20.03.33	66 100 000	JPY	639 021	609 787	0,02
Japan Government Thirty Year Bond 1.40% 15 - 20.09.45	83 600 000	JPY	873 311	834 475	0,03
Japan Government Thirty Year Bond 1.40% 15 - 20.12.45	117 300 000	JPY	1 101 258	1 171 383	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 1.50% 14 - 20.12.44	130 700 000	JPY	1 395 269	1 326 426	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 1.50% 15 - 20.03.45	185 050 000	JPY	1 862 647	1 879 165	0,07
Japan Government Thirty Year Bond 1.60% 15 - 20.06.45	100 000 000	JPY	1 073 748	1 035 776	0,04
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 03 - 20.06.33	68 700 000	JPY	710 354	678 195	0,03
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 13 - 20.12.43	170 700 000	JPY	1 726 912	1 789 285	0,07
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 14 - 20.03.44	204 100 000	JPY	2 189 505	2 141 490	0,08
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 14 - 20.06.44	145 850 000	JPY	1 579 237	1 531 899	0,06
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 14 - 20.09.44	150 550 000	JPY	1 538 114	1 582 830	0,06
Japan Government Thirty Year Bond 1.80% 02 - 22.11.32	64 400 000	JPY	652 585	638 999	0,03
Japan Government Thirty Year Bond 1.80% 13 - 20.03.43	258 850 000	JPY	2 637 137	2 751 622	0,11
Japan Government Thirty Year Bond 1.80% 13 - 20.09.43	174 650 000	JPY	1 831 148	1 861 159	0,07
Japan Government Thirty Year Bond 1.90% 12 - 20.09.42	460 350 000	JPY	4 769 119	4 958 569	0,19
Japan Government Thirty Year Bond 1.90% 13 - 20.06.43	205 900 000	JPY	2 206 467	2 227 089	0,09
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 04 - 20.12.33	98 000 000	JPY	1 031 581	1 002 346	0,04
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 10 - 20.09.40	389 750 000	JPY	4 133 665	4 198 791	0,16

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 11 - 20.09.41	391 600 000	JPY	4 233 281	4 256 307	0,17
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 12 - 20.03.42	378 800 000	JPY	4 150 372	4 130 626	0,16
Japan Government Thirty Year Bond 2.10% 03 - 20.09.33	93 650 000	JPY	984 395	965 954	0,04
Japan Government Thirty Year Bond 2.20% 09 - 20.09.39	283 600 000	JPY	3 195 010	3 121 539	0,12
Japan Government Thirty Year Bond 2.20% 11 - 20.03.41	345 900 000	JPY	3 801 389	3 856 279	0,15
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 02 - 20.05.32	67 000 000	JPY	725 605	694 523	0,03
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 05 - 20.03.35	129 050 000	JPY	1 372 551	1 381 037	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 05 - 20.06.35	104 150 000	JPY	1 132 035	1 116 906	0,04
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 06 - 20.12.35	116 050 000	JPY	1 273 817	1 250 910	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 07 - 20.12.36	116 900 000	JPY	1 250 446	1 272 382	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 09 - 20.03.39	295 250 000	JPY	3 139 610	3 275 305	0,13
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 10 - 20.03.40	359 350 000	JPY	3 959 416	4 022 805	0,16
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 01 - 20.11.31	55 100 000	JPY	588 684	573 000	0,02
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 04 - 20.03.34	115 050 000	JPY	1 202 031	1 231 320	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 05 - 20.12.34	100 250 000	JPY	1 120 760	1 082 239	0,04
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 07 - 20.03.37	209 450 000	JPY	2 293 570	2 312 452	0,09
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 08 - 20.09.38	286 500 000	JPY	3 109 091	3 206 730	0,13
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 04 - 20.06.34	142 400 000	JPY	1 534 408	1 543 858	0,06
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 04 - 20.09.34	97 000 000	JPY	1 083 590	1 054 335	0,04
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 05 - 20.09.35	94 150 000	JPY	1 060 965	1 035 089	0,04
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 06 - 20.03.36	141 000 000	JPY	1 604 261	1 558 760	0,06
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 06 - 20.06.36	142 500 000	JPY	1 661 816	1 582 140	0,06
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 06 - 20.09.36	105 750 000	JPY	1 218 464	1 175 441	0,05
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 07 - 20.09.37	209 500 000	JPY	2 347 955	2 352 407	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 08 - 20.03.38	271 750 000	JPY	3 012 565	3 065 902	0,12
Japan Government Thirty Year Bond 0.50% 19 - 20.03.49	253 750 000	JPY	2 160 507	2 054 065	0,08
Japan Government Thirty Year Bond 0.70% 19 - 20.12.48	249 350 000	JPY	2 130 480	2 127 081	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 0.20% 16 - 20.06.36	212 500 000	JPY	1 643 495	1 729 378	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 19 - 20.06.39	343 350 000	JPY	2 925 554	2 783 443	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 19 - 20.09.39	373 500 000	JPY	3 123 537	3 028 570	0,12
Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 20 - 20.12.39	338 300 000	JPY	2 889 799	2 738 875	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 0.40% 16 - 20.03.36	178 700 000	JPY	1 467 484	1 500 598	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 0.40% 20 - 20.03.40	210 050 000	JPY	1 795 867	1 729 444	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 16 - 20.09.36	153 050 000	JPY	1 290 236	1 302 436	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 18 - 20.03.38	280 600 000	JPY	2 228 707	2 372 378	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 18 - 20.06.38	358 150 000	JPY	2 986 232	3 025 258	0,12
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 16 - 20.12.36	274 650 000	JPY	2 265 449	2 371 122	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 17 - 20.06.37	216 800 000	JPY	1 822 507	1 869 560	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 17 - 20.09.37	278 950 000	JPY	2 372 178	2 403 963	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 17 - 20.12.37	224 950 000	JPY	1 835 906	1 937 427	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 0.70% 17 - 20.03.37	246 300 000	JPY	2 091 807	2 157 429	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 0.70% 18 - 20.09.38	308 800 000	JPY	2 653 745	2 697 498	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 0.80% 03 - 20.06.23	68 200 000	JPY	572 397	578 589	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 1.00% 03 - 20.03.23	90 600 000	JPY	788 354	771 002	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.00% 15 - 20.12.35	282 200 000	JPY	2 475 770	2 586 776	0,10
Japan Government Twenty Year Bond 1.20% 14 - 20.12.34	281 450 000	JPY	2 667 192	2 643 034	0,10
Japan Government Twenty Year Bond 1.20% 15 - 20.03.35	256 150 000	JPY	2 446 958	2 406 229	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 1.20% 15 - 20.09.35	222 250 000	JPY	1 945 835	2 090 108	0,08

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 1.30% 15 - 20.06.35	218 900 000	JPY	2 091 100	2 083 046	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 1.40% 03 - 20.12.22	57 150 000	JPY	502 488	489 730	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 1.40% 14 - 20.09.34	367 250 000	JPY	3 431 520	3 526 261	0,14
Japan Government Twenty Year Bond 1.50% 12 - 20.06.32	125 250 000	JPY	1 144 079	1 202 015	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 1.50% 13 - 20.03.33	174 750 000	JPY	1 572 905	1 686 149	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 1.50% 14 - 20.03.34	260 600 000	JPY	2 527 665	2 526 639	0,10
Japan Government Twenty Year Bond 1.50% 14 - 20.06.34	268 650 000	JPY	2 583 455	2 607 503	0,10
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 10 - 20.06.30	156 650 000	JPY	1 454 081	1 493 598	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 12 - 20.03.32	122 150 000	JPY	1 155 405	1 182 084	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 12 - 20.06.32	123 050 000	JPY	1 253 921	1 192 885	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 13 - 20.03.33	205 200 000	JPY	1 965 813	2 001 110	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 13 - 20.12.33	228 100 000	JPY	2 233 043	2 233 975	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 02 - 20.12.22	76 300 000	JPY	662 974	658 516	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 11 - 20.09.31	129 750 000	JPY	1 271 293	1 263 073	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 11 - 20.12.31	146 800 000	JPY	1 343 450	1 431 933	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 12 - 20.03.32	99 700 000	JPY	1 017 469	974 356	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 12 - 20.06.32	113 700 000	JPY	1 157 171	1 113 316	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 12 - 20.09.32	344 100 000	JPY	3 223 625	3 375 428	0,13
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 12 - 20.12.32	275 950 000	JPY	2 606 699	2 711 766	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 13 - 20.06.33	291 700 000	JPY	2 685 906	2 879 613	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 13 - 20.09.33	266 050 000	JPY	2 459 317	2 630 594	0,10
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 03 - 20.06.23	77 400 000	JPY	681 678	675 687	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 10 - 20.06.30	130 050 000	JPY	1 273 038	1 261 303	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 10 - 20.09.30	135 150 000	JPY	1 329 361	1 314 213	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 11 - 20.06.31	119 250 000	JPY	1 218 497	1 167 876	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 11 - 20.09.31	232 050 000	JPY	2 161 688	2 280 206	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 12 - 20.12.31	245 200 000	JPY	2 296 642	2 414 704	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 12 - 20.03.32	195 800 000	JPY	1 937 290	1 932 226	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 13 - 20.12.32	161 650 000	JPY	1 528 947	1 604 880	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 02 - 20.06.22	71 200 000	JPY	638 030	611 315	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 02 - 20.09.22	76 950 000	JPY	691 166	664 068	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 03 - 20.09.23	95 050 000	JPY	796 527	836 114	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 03 - 20.12.23	86 750 000	JPY	765 710	766 453	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 04 - 20.03.24	74 850 000	JPY	677 093	664 372	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 05 - 20.03.25	91 150 000	JPY	783 133	823 683	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 05 - 20.06.25	82 400 000	JPY	770 812	747 870	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 09 - 20.12.28	155 100 000	JPY	1 456 909	1 490 199	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 09 - 20.03.29	160 450 000	JPY	1 547 670	1 546 130	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 10 - 20.09.30	171 300 000	JPY	1 639 319	1 680 117	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 11 - 20.03.31	142 050 000	JPY	1 429 239	1 400 383	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 11 - 20.06.31	243 600 000	JPY	2 382 199	2 407 552	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 01 - 21.06.21	73 650 000	JPY	628 222	620 698	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 02 - 21.03.22	86 650 000	JPY	763 953	741 599	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 02 - 20.06.22	68 800 000	JPY	617 265	591 833	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 04 - 20.12.24	127 700 000	JPY	1 070 712	1 154 275	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 05 - 20.09.25	95 450 000	JPY	908 850	874 411	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 06 - 20.12.25	142 350 000	JPY	1 238 558	1 310 967	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 07 - 20.03.27	94 550 000	JPY	913 664	890 910	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 10 - 20.06.30	142 050 000	JPY	1 385 087	1 400 981	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 11 - 20.12.30	153 400 000	JPY	1 544 131	1 521 681	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 11 - 20.03.31	159 800 000	JPY	1 632 856	1 589 401	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 01 - 20.12.21	80 000 000	JPY	690 004	682 150	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 04 - 20.03.24	107 300 000	JPY	889 966	959 015	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 04 - 20.09.24	179 500 000	JPY	1 628 240	1 621 263	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 05 - 20.03.25	59 850 000	JPY	558 280	545 521	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 05 - 20.09.25	78 700 000	JPY	711 768	724 375	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 05 - 20.12.25	96 400 000	JPY	910 432	892 176	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 06 - 20.03.26	115 350 000	JPY	1 082 332	1 072 783	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 06 - 20.12.26	202 300 000	JPY	1 870 470	1 908 753	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 07 - 20.03.27	160 650 000	JPY	1 511 814	1 522 721	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 07 - 20.06.27	70 250 000	JPY	678 746	668 966	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 07 - 20.09.27	95 700 000	JPY	923 995	915 196	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 07 - 20.12.27	249 150 000	JPY	2 294 645	2 392 453	0,09
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 08 - 20.06.28	80 850 000	JPY	773 481	782 591	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 08 - 20.09.28	177 050 000	JPY	1 596 652	1 719 973	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 08 - 20.12.28	93 400 000	JPY	933 732	910 482	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 09 - 20.03.29	194 300 000	JPY	1 761 252	1 900 314	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 09 - 20.06.29	209 250 000	JPY	2 072 732	2 055 233	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 09 - 20.09.29	208 050 000	JPY	1 976 700	2 049 525	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 09 - 20.12.29	213 850 000	JPY	2 109 038	2 112 803	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 10 - 20.03.30	267 300 000	JPY	2 645 097	2 650 741	0,10
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 10 - 20.12.30	270 550 000	JPY	2 635 242	2 706 995	0,11

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 02 - 20.12.21	73 550 000	JPY	622 982	628 044	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 04 - 20.03.24	77 700 000	JPY	700 143	696 851	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 04 - 20.06.24	58 650 000	JPY	547 876	529 031	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 06 - 20.03.26	69 850 000	JPY	645 705	652 937	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 06 - 20.06.26	71 750 000	JPY	686 633	674 173	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 06 - 20.09.26	148 550 000	JPY	1 436 818	1 401 865	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 07 - 20.09.27	129 950 000	JPY	1 240 400	1 250 531	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 08 - 20.03.28	208 850 000	JPY	1 948 437	2 026 829	0,08
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 08 - 20.09.28	87 950 000	JPY	878 691	860 388	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 09 - 20.06.29	106 100 000	JPY	1 083 825	1 049 967	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 10 - 20.12.29	120 350 000	JPY	1 195 166	1 198 434	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 10 - 20.03.30	142 200 000	JPY	1 380 276	1 421 542	0,06
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 11 - 20.03.31	181 600 000	JPY	1 849 930	1 838 105	0,07
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 06 - 20.03.26	70 250 000	JPY	642 036	660 009	0,03
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 06 - 20.06.26	148 300 000	JPY	1 333 690	1 400 803	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 06 - 20.09.26	58 550 000	JPY	578 858	555 561	0,02
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 07 - 20.06.27	110 250 000	JPY	1 083 881	1 062 638	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 08 - 20.06.28	100 250 000	JPY	878 393	983 620	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 2.40% 04 - 20.06.24	129 450 000	JPY	1 104 093	1 176 183	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 2.40% 08 - 20.03.28	96 100 000	JPY	957 620	944 924	0,04
Japan Government Twenty Year Bond 2.40% 08 - 20.06.28	133 050 000	JPY	1 343 542	1 314 238	0,05
Japan Government Twenty Year Bond 0.40% 19 - 20.03.39	336 550 000	JPY	2 877 551	2 785 672	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 19 - 20.12.38	348 800 000	JPY	3 001 115	2 940 494	0,11
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 06.01.21	35 000 000	JPY	286 082	289 680	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 07.01.21	174 150 000	JPY	1 446 993	1 441 407	0,06
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 08.01.21	175 000 000	JPY	1 501 027	1 448 457	0,06
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 09.01.21	189 250 000	JPY	1 616 734	1 566 746	0,06
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 10.01.21	212 300 000	JPY	1 786 449	1 757 921	0,07
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 11.01.21	210 600 000	JPY	1 761 285	1 744 192	0,07
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 12.01.21	156 700 000	JPY	1 294 696	1 298 050	0,05
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 01.01.22	162 050 000	JPY	1 359 587	1 342 635	0,05
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 02.01.22	213 550 000	JPY	1 806 846	1 769 681	0,07
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 03.01.22	212 000 000	JPY	1 791 774	1 757 151	0,07
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 04.01.22	164 100 000	JPY	1 408 266	1 360 392	0,05
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 05.01.22	150 000 000	JPY	1 260 374	1 243 738	0,05
			467 477 335	470 677 006	18,38
Pays-Bas					
Netherlands Zero Coupon 16 - 15.01.22	1 798 000	EUR	1 810 057	1 814 901	0,07
Netherlands Zero Coupon 17 - 15.01.24	1 932 000	EUR	1 957 676	1 975 470	0,08
Netherlands Zero Coupon 20 - 15.07.30	1 339 000	EUR	1 380 494	1 380 911	0,05
Netherlands 0.25% 15 - 15.07.25	1 859 000	EUR	1 898 709	1 938 937	0,08
Netherlands 0.25% 19 - 15.07.29	1 552 000	EUR	1 596 381	1 642 482	0,06
Netherlands 0.50% 16 - 15.07.26	2 055 000	EUR	2 151 850	2 187 342	0,09
Netherlands 0.50% 19 - 15.01.40	893 000	EUR	962 026	988 640	0,04
Netherlands 0.75% 17 - 15.07.27	1 854 000	EUR	1 965 268	2 016 781	0,08
Netherlands 0.75% 18 - 15.07.28	1 550 000	EUR	1 654 643	1 700 195	0,07
Netherlands 1.75% 13 - 15.07.23	2 242 000	EUR	2 389 339	2 406 338	0,09
Netherlands 2.00% 14 - 15.07.24	1 909 000	EUR	2 071 388	2 114 027	0,08
Netherlands 2.25% 12 - 15.07.22	1 840 000	EUR	1 944 355	1 949 112	0,08
Netherlands 2.50% 12 - 15.01.33	1 653 000	EUR	2 137 021	2 228 575	0,09
Netherlands 2.75% 14 - 15.01.47	2 039 000	EUR	3 188 502	3 529 917	0,14
Netherlands 3.25% 11 - 15.07.21	2 040 000	EUR	2 122 153	2 121 192	0,08
Netherlands 3.75% 06 - 15.01.23	530 000	EUR	583 615	589 890	0,02
Netherlands 3.75% 10 - 15.01.42	1 984 000	EUR	3 308 091	3 620 205	0,14
Netherlands 4.00% 05 - 15.01.37	1 941 000	EUR	3 053 793	3 279 319	0,13
Netherlands 5.50% 98 - 15.01.28	1 631 000	EUR	2 275 718	2 374 573	0,09
Netherlands 7.50% 93 - 15.01.23	1 051 000	EUR	1 273 589	1 270 974	0,05
			39 724 668	41 129 781	1,61
Norvège					
Norway 1.375% 20 - 19.08.30	5 368 000	NOK	526 575	532 315	0,02
Norway 1.50% 16 - 19.02.26	4 240 000	NOK	436 419	415 319	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Norvège (suite)					
Norway 1.75% 15 - 13.03.25	4 654 000	NOK	453 539	458 140	0,02
Norway 1.75% 17 - 17.02.27	4 860 000	NOK	507 712	486 358	0,02
Norway 1.75% 19 - 09.06.29	3 970 000	NOK	406 705	404 364	0,02
Norway 2.00% 12 - 24.05.23	9 400 000	NOK	979 904	913 016	0,03
Norway 2.00% 18 - 26.04.28	4 870 000	NOK	510 825	500 078	0,02
Norway 3.00% 14 - 14.03.24	6 306 000	NOK	673 311	641 016	0,02
			4 494 990	4 350 606	0,17
Singapour					
Singapore 1.25% 16 - 10.01.21	1 105 000	SGD	709 394	713 629	0,03
Singapore 1.75% 17 - 04.01.22	610 000	SGD	396 337	399 282	0,02
Singapore 1.75% 18 - 02.01.23	1 362 000	SGD	883 244	900 814	0,03
Singapore 1.875% 20 - 03.01.50	264 000	SGD	197 111	192 332	0,01
Singapore 2.00% 19 - 02.01.24	250 000	SGD	162 224	168 618	0,01
Singapore 2.125% 16 - 06.01.26	937 000	SGD	648 480	649 743	0,02
Singapore 2.25% 11 - 06.01.21	720 000	SGD	473 360	467 654	0,02
Singapore 2.25% 16 - 08.01.36	400 000	SGD	264 320	293 097	0,01
Singapore 2.375% 15 - 06.01.25	560 000	SGD	358 700	389 250	0,01
Singapore 2.375% 19 - 07.01.39	320 000	SGD	223 267	241 994	0,01
Singapore 2.625% 18 - 05.01.28	350 000	SGD	237 971	253 780	0,01
Singapore 2.75% 12 - 04.01.42	590 000	SGD	425 316	478 710	0,02
Singapore 2.75% 13 - 07.01.23	1 100 000	SGD	712 832	751 750	0,03
Singapore 2.75% 16 - 03.01.46	865 000	SGD	606 305	719 007	0,03
Singapore 2.875% 10 - 09.01.30	370 000	SGD	268 192	279 357	0,01
Singapore 2.875% 14 - 07.01.29	966 000	SGD	709 244	721 394	0,03
Singapore 3.00% 09 - 09.01.24	660 000	SGD	465 865	465 540	0,02
Singapore 3.375% 13 - 09.01.33	800 000	SGD	559 251	652 060	0,02
Singapore 3.50% 07 - 03.01.27	880 000	SGD	635 284	662 731	0,03
			8 936 697	9 400 742	0,37
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 30.04.23	1 660 000	EUR	1 670 607	1 673 761	0,07
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	1 494 000	EUR	1 482 529	1 503 203	0,06
Spain 0.05% 18 - 31.10.21	2 397 000	EUR	2 406 406	2 412 386	0,09
Spain 0.25% 19 - 30.07.24	2 038 000	EUR	2 074 364	2 076 130	0,08
Spain 0.35% 18 - 30.07.23	2 744 000	EUR	2 762 386	2 797 850	0,11
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	2 496 000	EUR	2 525 242	2 532 969	0,10
Spain 0.45% 17 - 31.10.22	2 167 000	EUR	2 185 646	2 209 022	0,09
Spain 0.50% 20 - 30.04.30	2 304 000	EUR	2 325 465	2 325 727	0,09
Spain 0.60% 19 - 31.10.29	2 560 000	EUR	2 608 927	2 619 059	0,10
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	2 620 000	EUR	2 644 326	2 654 532	0,10
Spain 0.80% 20 - 30.07.27	1 593 000	EUR	1 634 232	1 665 848	0,06
Spain 1.00% 20 - 31.10.50	1 022 000	EUR	915 522	954 640	0,04
Spain 1.25% 20 - 31.10.30	2 313 000	EUR	2 422 144	2 496 352	0,10
Spain 1.30% 16 - 31.10.26	3 275 000	EUR	3 374 430	3 535 344	0,14
Spain 1.40% 18 - 30.04.28	2 540 000	EUR	2 700 322	2 775 383	0,11
Spain 1.40% 18 - 30.07.28	2 526 000	EUR	2 611 399	2 762 431	0,11
Spain 1.45% 17 - 31.10.27	2 643 000	EUR	2 748 043	2 888 886	0,11
Spain 1.45% 19 - 30.04.29	2 513 000	EUR	2 669 518	2 762 003	0,11
Spain 1.50% 17 - 30.04.27	2 484 000	EUR	2 589 150	2 722 366	0,11

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain 1.60% 15 - 30.04.25	2 621 000	EUR	2 746 878	2 841 163	0,11
Spain 1.85% 19 - 30.07.35	1 725 000	EUR	1 909 557	1 982 870	0,08
Spain 1.95% 15 - 30.07.30	2 793 000	EUR	3 052 078	3 212 517	0,13
Spain 1.95% 16 - 30.04.26	2 658 000	EUR	2 878 948	2 964 495	0,12
Spain 2.15% 15 - 31.10.25	2 857 000	EUR	3 102 981	3 196 239	0,12
Spain 2.35% 17 - 30.07.33	2 372 000	EUR	2 677 464	2 872 693	0,11
Spain 2.70% 18 - 31.10.48	1 789 000	EUR	2 165 092	2 418 071	0,09
Spain 2.75% 14 - 31.10.24	3 085 000	EUR	3 408 350	3 477 730	0,14
Spain 2.90% 16 - 31.10.46	2 168 000	EUR	2 746 989	3 006 507	0,12
Spain 3.45% 16 - 30.07.66	1 652 000	EUR	2 400 698	2 717 006	0,11
Spain 3.80% 14 - 30.04.24	2 554 000	EUR	2 852 929	2 951 251	0,11
Spain 4.20% 05 - 31.01.37	2 524 000	EUR	3 540 170	3 838 483	0,15
Spain 4.40% 13 - 31.10.23	2 510 000	EUR	2 846 264	2 904 841	0,11
Spain 4.65% 10 - 30.07.25	2 835 000	EUR	3 438 607	3 521 809	0,14
Spain 4.70% 09 - 30.07.41	2 501 000	EUR	3 827 247	4 233 427	0,16
Spain 4.80% 08 - 31.01.24	2 301 000	EUR	2 695 004	2 720 632	0,11
Spain 4.90% 07 - 30.07.40	2 324 000	EUR	3 599 571	3 975 562	0,15
Spain 5.15% 13 - 31.10.28	2 380 000	EUR	3 225 400	3 335 296	0,13
Spain 5.15% 13 - 31.10.44	1 766 000	EUR	2 859 309	3 275 143	0,13
Spain 5.40% 13 - 31.01.23	2 815 000	EUR	3 202 364	3 233 693	0,13
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	2 840 000	EUR	4 309 623	4 560 069	0,18
Spain 5.85% 11 - 31.01.22	2 891 000	EUR	3 167 276	3 179 288	0,12
Spain 5.90% 11 - 30.07.26	2 665 000	EUR	3 531 608	3 619 463	0,14
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	3 196 000	EUR	4 517 712	4 742 168	0,18
			119 052 777	124 148 308	4,85
Suède					
Sweden 0.75% 17 - 05.12.28	5 970 000	SEK	603 920	611 149	0,02
Sweden 0.75% 18 - 11.12.29	6 525 000	SEK	650 427	670 309	0,03
Sweden 1.00% 15 - 11.12.26	7 430 000	SEK	763 523	766 276	0,03
Sweden 1.50% 12 - 13.11.23	10 100 000	SEK	1 054 366	1 024 788	0,04
Sweden 2.50% 14 - 05.12.25	8 430 000	SEK	914 346	916 368	0,04
Sweden 3.50% 09 - 30.03.39	5 820 000	SEK	821 170	867 438	0,03
Sweden 3.50% 11 - 06.01.22	11 180 000	SEK	1 136 311	1 147 265	0,04
			5 944 063	6 003 593	0,23
Royaume-Uni					
United Kingdom Gilt 0.125% 20 - 31.01.23	977 000	GBP	1 125 222	1 079 547	0,04
United Kingdom Gilt 0.375% 20 - 22.10.30	1 430 000	GBP	1 613 415	1 598 501	0,06
United Kingdom Gilt 0.50% 16 - 22.07.22	3 145 000	GBP	3 595 303	3 501 398	0,14
United Kingdom Gilt 0.50% 20 - 22.10.61	850 000	GBP	951 501	913 969	0,04
United Kingdom Gilt 0.625% 19 - 06.07.25	3 490 000	GBP	4 061 247	3 968 042	0,15
United Kingdom Gilt 0.75% 17 - 22.07.23	3 080 000	GBP	3 549 843	3 473 420	0,14
United Kingdom Gilt 0.875% 19 - 22.10.29	2 991 000	GBP	3 557 506	3 517 832	0,14
United Kingdom Gilt 1.00% 18 - 22.04.24	3 057 000	GBP	3 537 676	3 500 619	0,14
United Kingdom Gilt 1.25% 17 - 22.07.27	1 936 000	GBP	2 328 714	2 315 342	0,09
United Kingdom Gilt 1.25% 20 - 22.10.41	754 000	GBP	955 721	932 680	0,04
United Kingdom Gilt 1.50% 16 - 22.07.26	1 283 000	GBP	1 546 482	1 543 722	0,06
United Kingdom Gilt 1.50% 16 - 22.07.47	2 526 000	GBP	3 052 584	3 368 589	0,13
United Kingdom Gilt 1.625% 18 - 22.10.28	1 926 000	GBP	2 322 535	2 393 857	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
United Kingdom Gilt 1.625% 18 - 22.10.71	1 213 000	GBP	1 681 646	2 017 683	0,08
United Kingdom Gilt 1.625% 19 - 22.10.54	1 237 000	GBP	1 683 783	1 781 488	0,07
United Kingdom Gilt 1.75% 12 - 09.07.22	2 932 000	GBP	3 478 043	3 354 576	0,13
United Kingdom Gilt 1.75% 16 - 09.07.37	3 220 000	GBP	4 001 583	4 240 594	0,17
United Kingdom Gilt 1.75% 17 - 22.07.57	1 997 000	GBP	2 652 974	3 042 324	0,12
United Kingdom Gilt 1.75% 18 - 22.01.49	1 788 000	GBP	2 398 204	2 530 763	0,10
United Kingdom Gilt 2.00% 15 - 09.07.25	1 621 000	GBP	2 008 414	1 977 853	0,08
United Kingdom Gilt 2.25% 13 - 09.07.23	1 755 000	GBP	2 103 430	2 072 812	0,08
United Kingdom Gilt 2.50% 15 - 22.07.65	2 061 000	GBP	3 435 699	4 018 785	0,16
United Kingdom Gilt 2.75% 14 - 09.07.24	1 405 000	GBP	1 769 740	1 728 059	0,07
United Kingdom Gilt 3.25% 12 - 22.01.44	2 740 000	GBP	4 191 344	4 723 456	0,18
United Kingdom Gilt 3.50% 13 - 22.07.68	1 942 000	GBP	4 009 894	4 784 118	0,19
United Kingdom Gilt 3.50% 14 - 22.01.45	2 720 000	GBP	4 447 817	4 924 475	0,19
United Kingdom Gilt 3.75% 11 - 09.07.21	1 906 000	GBP	2 275 305	2 189 929	0,09
United Kingdom Gilt 3.75% 11 - 22.07.52	1 814 000	GBP	3 353 357	3 815 823	0,15
United Kingdom Gilt 4.00% 09 - 03.07.22	1 729 000	GBP	2 063 791	2 032 593	0,08
United Kingdom Gilt 4.00% 09 - 22.01.60	1 709 000	GBP	3 578 500	4 161 427	0,16
United Kingdom Gilt 4.25% 00 - 06.07.32	2 289 000	GBP	3 533 384	3 687 366	0,14
United Kingdom Gilt 4.25% 03 - 03.07.36	2 314 000	GBP	3 751 027	3 996 971	0,16
United Kingdom Gilt 4.25% 05 - 12.07.55	2 204 000	GBP	4 739 378	5 232 672	0,20
United Kingdom Gilt 4.25% 06 - 12.07.46	2 162 000	GBP	3 936 165	4 455 809	0,17
United Kingdom Gilt 4.25% 06 - 12.07.27	1 728 000	GBP	2 449 413	2 497 165	0,10
United Kingdom Gilt 4.25% 08 - 12.07.49	1 653 000	GBP	3 200 891	3 573 533	0,14
United Kingdom Gilt 4.25% 09 - 09.07.39	1 759 000	GBP	3 031 061	3 229 509	0,13
United Kingdom Gilt 4.25% 10 - 12.07.40	2 037 000	GBP	3 550 050	3 812 745	0,15
United Kingdom Gilt 4.50% 07 - 12.07.42	2 365 000	GBP	4 425 385	4 715 736	0,18
United Kingdom Gilt 4.50% 09 - 09.07.34	1 700 000	GBP	2 805 397	2 924 066	0,11
United Kingdom Gilt 4.75% 04 - 12.07.38	1 911 000	GBP	3 442 909	3 654 902	0,14
United Kingdom Gilt 4.75% 07 - 12.07.30	1 972 000	GBP	3 143 354	3 195 799	0,12
United Kingdom Gilt 5.00% 01 - 03.07.25	2 145 000	GBP	2 902 300	2 918 078	0,11
United Kingdom Gilt 6.00% 98 - 12.07.28	1 353 000	GBP	2 184 320	2 223 764	0,09
United Kingdom Gilt 8.00% 96 - 06.07.21	1 550 000	GBP	1 904 797	1 831 200	0,07
			130 331 104	137 453 591	5,37
États-Unis					
United States Treasury Bond 0.125% 20 - 30.04.22	5 200 000	USD	4 671 653	4 626 942	0,18
United States Treasury Bond 0.125% 20 - 15.05.23	5 000 000	USD	4 486 630	4 445 505	0,17
United States Treasury Bond 0.25% 20 - 15.04.23	4 774 000	USD	4 353 119	4 259 843	0,17
United States Treasury Bond 0.375% 20 - 31.03.22	4 524 000	USD	4 143 862	4 042 433	0,16
United States Treasury Bond 0.375% 20 - 30.04.25	5 300 000	USD	4 777 753	4 739 516	0,18
United States Treasury Bond 0.50% 20 - 15.03.23	4 256 000	USD	3 913 537	3 822 499	0,15
United States Treasury Bond 0.50% 20 - 31.03.25	5 150 000	USD	4 728 402	4 632 604	0,18
United States Treasury Bond 0.50% 20 - 30.04.27	4 400 000	USD	3 959 120	3 923 062	0,15
United States Treasury Bond 0.625% 20 - 31.03.27	3 519 000	USD	3 231 574	3 164 484	0,12
United States Treasury Bond 0.625% 20 - 15.05.30	3 900 000	USD	3 495 746	3 463 153	0,14
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 30.06.21	3 920 000	USD	3 603 844	3 522 904	0,14
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 31.07.21	3 520 000	USD	3 038 005	3 165 873	0,12
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 31.08.21	3 963 000	USD	3 592 878	3 567 062	0,14
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 30.09.21	3 610 000	USD	3 195 947	3 251 841	0,13

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 1.125% 20 - 28.02.22	4 489 000	USD	4 161 926	4 060 494	0,16
United States Treasury Bond 1.125% 20 - 28.02.25	4 950 000	USD	4 684 649	4 582 849	0,18
United States Treasury Bond 1.125% 20 - 28.02.27	2 146 000	USD	2 037 427	1 993 096	0,08
United States Treasury Bond 1.25% 16 - 31.07.23	3 322 000	USD	2 809 782	3 054 804	0,12
United States Treasury Bond 1.25% 16 - 31.10.21	4 116 000	USD	3 630 524	3 716 800	0,14
United States Treasury Bond 1.25% 19 - 31.08.24	3 929 000	USD	3 566 796	3 644 138	0,14
United States Treasury Bond 1.25% 20 - 15.05.50	2 700 000	USD	2 335 290	2 310 049	0,09
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 31.05.21	3 424 000	USD	3 082 516	3 081 912	0,12
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 30.06.23	3 197 000	USD	2 786 290	2 948 308	0,11
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 31.08.23	3 370 000	USD	2 833 718	3 113 946	0,12
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 30.09.23	3 230 000	USD	2 803 875	2 986 830	0,12
United States Treasury Bond 1.375% 19 - 31.08.26	3 040 000	USD	2 744 369	2 863 998	0,11
United States Treasury Bond 1.375% 19 - 15.10.22	3 487 000	USD	3 159 682	3 190 039	0,12
United States Treasury Bond 1.375% 20 - 31.01.22	3 316 000	USD	3 025 804	3 008 691	0,12
United States Treasury Bond 1.375% 20 - 31.01.25	4 461 000	USD	4 082 505	4 171 699	0,16
United States Treasury Bond 1.375% 20 - 15.02.23	3 076 000	USD	2 840 805	2 825 167	0,11
United States Treasury Bond 1.50% 15 - 31.01.22	3 496 000	USD	3 082 527	3 177 846	0,12
United States Treasury Bond 1.50% 16 - 28.02.23	3 074 000	USD	2 778 253	2 833 593	0,11
United States Treasury Bond 1.50% 16 - 31.03.23	3 299 000	USD	2 856 504	3 044 210	0,12
United States Treasury Bond 1.50% 16 - 15.08.26	7 324 000	USD	6 538 719	6 947 864	0,27
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 15.08.22	4 273 000	USD	3 906 327	3 912 074	0,15
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 31.08.21	3 777 000	USD	3 484 618	3 414 357	0,13
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 15.09.22	4 184 000	USD	3 838 921	3 835 248	0,15
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.09.21	4 084 000	USD	3 748 178	3 695 858	0,14
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.09.24	4 303 000	USD	3 964 265	4 034 721	0,16
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 31.10.21	4 492 000	USD	4 058 239	4 070 081	0,16
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 31.10.24	4 509 000	USD	4 064 953	4 230 387	0,17
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.11.21	4 898 000	USD	4 452 143	4 442 717	0,17
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.11.24	4 815 000	USD	4 298 140	4 521 498	0,18
United States Treasury Bond 1.50% 20 - 15.01.23	3 200 000	USD	2 967 944	2 945 288	0,11
United States Treasury Bond 1.50% 20 - 31.01.27	2 738 000	USD	2 600 799	2 602 337	0,10
United States Treasury Bond 1.50% 20 - 15.02.30	9 146 000	USD	8 911 810	8 803 529	0,34
United States Treasury Bond 1.625% 12 - 15.08.22	2 912 000	USD	2 698 125	2 672 920	0,10
United States Treasury Bond 1.625% 12 - 15.11.22	7 133 000	USD	6 392 858	6 570 192	0,26
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 15.02.26	6 961 000	USD	6 289 900	6 629 653	0,26
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 30.04.23	3 362 000	USD	2 995 329	3 115 440	0,12
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 15.05.26	7 350 000	USD	6 300 750	7 011 383	0,27
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 31.05.23	3 122 200	USD	2 791 694	2 897 135	0,11
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 31.10.23	3 183 000	USD	2 692 281	2 968 608	0,12
United States Treasury Bond 1.625% 17 - 31.08.22	3 921 000	USD	3 447 156	3 600 715	0,14
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 30.06.21	2 870 000	USD	2 611 621	2 592 046	0,10
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 15.08.29	6 437 000	USD	5 920 148	6 253 279	0,24
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 30.09.26	2 952 000	USD	2 681 177	2 821 750	0,11
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 31.10.26	3 341 000	USD	3 101 981	3 195 910	0,12
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 30.11.26	2 989 000	USD	2 741 324	2 860 028	0,11
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 15.12.22	3 996 000	USD	3 601 695	3 685 155	0,14
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 31.12.21	3 636 000	USD	3 308 386	3 308 140	0,13
United States Treasury Bond 1.75% 12 - 15.05.22	3 040 000	USD	2 637 112	2 786 604	0,11

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 1.75% 13 - 15.05.23	5 729 000	USD	5 023 784	5 331 167	0,21
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 28.02.22	3 712 000	USD	3 285 952	3 391 230	0,13
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 31.03.22	3 410 000	USD	2 998 943	3 119 597	0,12
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 30.04.22	3 472 000	USD	3 142 775	3 180 664	0,12
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 30.09.22	3 299 000	USD	2 934 687	3 041 456	0,12
United States Treasury Bond 1.75% 16 - 31.01.23	3 203 000	USD	2 884 496	2 967 210	0,12
United States Treasury Bond 1.75% 16 - 30.11.21	4 190 000	USD	3 743 857	3 813 934	0,15
United States Treasury Bond 1.75% 17 - 31.05.22	3 852 100	USD	3 429 920	3 533 156	0,14
United States Treasury Bond 1.75% 17 - 30.06.22	3 712 000	USD	3 256 682	3 409 304	0,13
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 15.06.22	4 220 000	USD	3 788 079	3 874 118	0,15
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 30.06.24	4 221 000	USD	3 881 837	3 986 020	0,16
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 15.07.22	3 686 000	USD	3 317 334	3 387 475	0,13
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.07.21	4 070 000	USD	3 685 552	3 685 453	0,14
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.07.24	4 226 000	USD	3 838 298	3 994 269	0,16
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 15.11.29	5 052 000	USD	4 728 408	4 966 143	0,19
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.12.24	4 349 000	USD	4 064 223	4 129 885	0,16
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.12.26	3 105 000	USD	2 904 364	2 994 349	0,12
United States Treasury Bond 1.875% 14 - 30.11.21	3 657 000	USD	3 440 866	3 334 369	0,13
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.05.22	3 548 000	USD	3 190 855	3 261 639	0,13
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.08.22	3 468 000	USD	3 067 988	3 201 605	0,12
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.10.22	3 150 000	USD	2 776 455	2 915 920	0,11
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.01.22	3 536 000	USD	3 107 682	3 232 898	0,13
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 28.02.22	3 388 000	USD	3 138 742	3 101 827	0,12
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.03.22	3 208 000	USD	2 897 246	2 941 047	0,11
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 30.04.22	4 068 000	USD	3 601 362	3 734 576	0,15
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.07.22	3 791 000	USD	3 391 455	3 495 574	0,14
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.08.24	3 432 000	USD	2 964 133	3 262 906	0,13
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 30.09.22	3 590 000	USD	3 145 116	3 319 228	0,13
United States Treasury Bond 1.875% 19 - 30.06.26	3 400 000	USD	3 103 452	3 291 134	0,13
United States Treasury Bond 1.875% 19 - 31.07.26	3 277 000	USD	2 996 457	3 173 896	0,12
United States Treasury Bond 2.00% 11 - 15.11.21	4 936 000	USD	4 343 622	4 503 965	0,18
United States Treasury Bond 2.00% 12 - 15.02.22	3 322 000	USD	2 908 550	3 045 099	0,12
United States Treasury Bond 2.00% 13 - 15.02.23	6 017 000	USD	5 279 721	5 613 398	0,22
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.05.21	2 633 000	USD	2 405 253	2 383 127	0,09
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.08.21	3 128 000	USD	2 814 013	2 844 206	0,11
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.10.21	3 440 000	USD	3 077 280	3 136 992	0,12
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 15.02.25	7 306 000	USD	6 657 002	7 021 247	0,27
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 31.07.22	3 565 000	USD	3 172 156	3 295 121	0,13
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 15.08.25	7 300 000	USD	6 546 408	7 056 103	0,28
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 30.11.22	6 905 000	USD	6 041 912	6 418 779	0,25
United States Treasury Bond 2.00% 16 - 15.11.26	6 600 000	USD	5 844 568	6 452 027	0,25
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 31.12.21	3 425 000	USD	2 986 676	3 132 843	0,12
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 30.04.24	3 037 000	USD	2 709 867	2 887 367	0,11
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 31.05.24	5 584 000	USD	5 062 221	5 315 868	0,21
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 30.06.24	3 000 000	USD	2 653 457	2 858 868	0,11
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 31.10.22	3 672 000	USD	3 175 838	3 408 835	0,13
United States Treasury Bond 2.00% 20 - 15.02.50	6 382 000	USD	6 680 017	6 507 932	0,25
United States Treasury Bond 2.125% 11 - 15.08.21	4 182 000	USD	3 692 227	3 804 325	0,15

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 30.06.21	3 023 000	USD	2 759 006	2 743 686	0,11
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 30.09.21	3 286 000	USD	3 064 419	2 996 557	0,12
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 31.12.21	3 530 000	USD	3 158 276	3 234 779	0,13
United States Treasury Bond 2.125% 15 - 15.05.25	6 861 000	USD	6 268 376	6 649 906	0,26
United States Treasury Bond 2.125% 15 - 30.06.22	3 493 000	USD	3 151 505	3 231 488	0,13
United States Treasury Bond 2.125% 15 - 31.12.22	6 532 000	USD	5 926 026	6 099 305	0,24
United States Treasury Bond 2.125% 16 - 30.11.23	3 389 000	USD	2 975 765	3 215 424	0,13
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 29.02.24	3 102 000	USD	2 806 192	2 955 206	0,12
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 31.03.24	7 380 000	USD	6 653 834	7 038 975	0,27
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 31.07.24	3 052 000	USD	2 698 511	2 925 830	0,11
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 30.09.24	2 983 000	USD	2 677 624	2 866 737	0,11
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 30.11.24	3 063 000	USD	2 823 176	2 950 863	0,12
United States Treasury Bond 2.125% 19 - 15.05.22	3 699 000	USD	3 411 189	3 413 831	0,13
United States Treasury Bond 2.125% 19 - 31.05.21	3 123 000	USD	2 785 846	2 830 101	0,11
United States Treasury Bond 2.125% 19 - 31.05.26	3 437 000	USD	3 169 402	3 369 026	0,13
United States Treasury Bond 2.25% 14 - 31.07.21	3 500 000	USD	3 042 702	3 185 377	0,12
United States Treasury Bond 2.25% 14 - 15.11.24	7 459 000	USD	6 655 762	7 217 055	0,28
United States Treasury Bond 2.25% 15 - 15.11.25	7 520 000	USD	6 623 380	7 376 508	0,29
United States Treasury Bond 2.25% 16 - 15.08.46	4 308 000	USD	3 730 787	4 547 632	0,18
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 31.12.23	2 985 000	USD	2 608 989	2 847 480	0,11
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 31.01.24	3 170 000	USD	3 020 442	3 028 368	0,12
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 15.02.27	6 063 000	USD	5 648 407	6 029 126	0,24
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 15.08.27	7 075 000	USD	6 351 818	7 074 842	0,28
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 31.10.24	3 075 000	USD	2 807 317	2 973 118	0,12
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 15.11.27	6 587 000	USD	5 771 015	6 604 264	0,26
United States Treasury Bond 2.25% 18 - 31.12.24	3 216 000	USD	2 929 317	3 117 947	0,12
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 31.03.26	3 556 000	USD	3 244 513	3 502 987	0,14
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 15.04.22	4 011 000	USD	3 622 948	3 704 010	0,14
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 30.04.24	4 680 000	USD	4 356 210	4 489 783	0,18
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 15.08.49	6 018 000	USD	5 804 114	6 443 169	0,25
United States Treasury Bond 2.375% 14 - 15.08.24	7 849 000	USD	7 211 211	7 600 956	0,30
United States Treasury Bond 2.375% 17 - 15.05.27	6 905 000	USD	6 296 330	6 937 507	0,27
United States Treasury Bond 2.375% 18 - 31.01.23	3 802 000	USD	3 438 799	3 577 122	0,14
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 29.02.24	3 443 000	USD	3 191 735	3 307 850	0,13
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 15.03.22	3 806 000	USD	3 458 042	3 515 759	0,14
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 30.04.26	3 086 000	USD	2 858 454	3 062 748	0,12
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 15.05.29	6 976 000	USD	6 564 414	7 168 000	0,28
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 15.11.49	5 427 000	USD	5 425 473	5 967 453	0,23
United States Treasury Bond 2.50% 13 - 15.08.23	5 342 000	USD	4 976 523	5 099 609	0,20
United States Treasury Bond 2.50% 14 - 15.05.24	7 530 000	USD	6 870 637	7 293 085	0,28
United States Treasury Bond 2.50% 15 - 15.02.45	4 403 000	USD	4 003 931	4 835 352	0,19
United States Treasury Bond 2.50% 16 - 15.02.46	4 187 000	USD	3 774 061	4 616 198	0,18
United States Treasury Bond 2.50% 16 - 15.05.46	4 181 000	USD	3 634 471	4 617 145	0,18
United States Treasury Bond 2.50% 18 - 31.01.25	3 249 000	USD	2 989 296	3 186 553	0,12
United States Treasury Bond 2.50% 18 - 31.03.23	3 262 000	USD	2 932 105	3 089 483	0,12
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 15.01.22	4 082 000	USD	3 657 167	3 764 465	0,15
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 31.01.24	4 351 000	USD	3 958 076	4 191 104	0,16
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 15.02.22	3 825 000	USD	3 435 573	3 533 842	0,14

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 28.02.26	3 245 000	USD	2 991 526	3 234 093	0,13
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 28.02.23	3 168 000	USD	2 899 266	3 004 420	0,12
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 31.03.25	2 569 000	USD	2 428 636	2 540 351	0,10
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.06.21	2 853 000	USD	2 566 493	2 599 315	0,10
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 30.06.23	3 444 000	USD	3 129 733	3 290 604	0,13
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.07.21	3 231 000	USD	2 864 098	2 949 548	0,12
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.12.21	2 898 000	USD	2 627 383	2 672 567	0,10
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 31.12.23	4 522 000	USD	4 180 100	4 366 514	0,17
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 31.12.25	2 914 000	USD	2 724 457	2 915 557	0,11
United States Treasury Bond 2.625% 19 - 31.01.26	3 291 000	USD	3 078 524	3 296 878	0,13
United States Treasury Bond 2.625% 19 - 15.02.29	7 908 000	USD	7 477 543	8 251 068	0,32
United States Treasury Bond 2.75% 12 - 15.08.42	2 371 000	USD	2 190 876	2 706 732	0,11
United States Treasury Bond 2.75% 12 - 15.11.42	2 990 000	USD	2 775 408	3 410 055	0,13
United States Treasury Bond 2.75% 13 - 15.11.23	6 934 000	USD	6 334 013	6 704 261	0,26
United States Treasury Bond 2.75% 14 - 15.02.24	5 853 000	USD	5 393 477	5 689 204	0,22
United States Treasury Bond 2.75% 17 - 15.08.47	4 298 000	USD	3 922 700	4 999 273	0,20
United States Treasury Bond 2.75% 17 - 15.11.47	4 437 000	USD	4 260 294	5 168 360	0,20
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 15.02.28	7 718 000	USD	7 272 513	8 016 319	0,31
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 28.02.25	3 210 000	USD	2 907 167	3 185 814	0,12
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 30.04.23	3 358 000	USD	3 033 302	3 207 033	0,13
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 31.05.23	3 460 000	USD	3 113 197	3 310 705	0,13
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 30.06.25	2 920 000	USD	2 565 814	2 915 466	0,11
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 31.07.23	3 228 000	USD	2 983 792	3 100 841	0,12
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 15.08.21	3 260 000	USD	2 902 613	2 985 999	0,12
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 31.08.23	3 114 000	USD	2 929 455	2 996 963	0,12
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 31.08.25	3 120 000	USD	3 000 608	3 124 271	0,12
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 15.09.21	3 098 000	USD	2 797 148	2 843 649	0,11
United States Treasury Bond 2.875% 13 - 15.05.43	3 912 000	USD	3 586 452	4 550 292	0,18
United States Treasury Bond 2.875% 15 - 15.08.45	3 898 000	USD	3 935 178	4 572 510	0,18
United States Treasury Bond 2.875% 16 - 15.11.46	3 994 000	USD	3 885 521	4 729 017	0,18
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 30.04.25	3 156 000	USD	2 855 774	3 158 564	0,12
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.05.28	7 981 000	USD	7 300 449	8 386 081	0,33
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 31.05.25	3 275 000	USD	3 003 684	3 283 128	0,13
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 31.07.25	3 310 000	USD	3 056 038	3 328 345	0,13
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.08.28	8 203 000	USD	7 676 069	8 650 161	0,34
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 30.09.23	3 796 000	USD	3 386 979	3 673 398	0,14
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.10.21	3 710 000	USD	3 354 512	3 418 306	0,13
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 31.10.23	3 593 000	USD	3 298 880	3 483 953	0,14
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.11.21	3 642 000	USD	3 247 212	3 362 239	0,13
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 30.11.23	3 419 000	USD	3 184 468	3 321 893	0,13
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 30.11.25	3 228 000	USD	3 002 480	3 264 752	0,13
United States Treasury Bond 2.875% 19 - 15.05.49	6 067 000	USD	6 227 345	7 306 740	0,29
United States Treasury Bond 3.00% 12 - 15.05.42	1 660 000	USD	1 596 145	1 968 031	0,08
United States Treasury Bond 3.00% 14 - 15.11.44	3 992 000	USD	4 087 170	4 758 305	0,19
United States Treasury Bond 3.00% 15 - 15.05.45	3 817 000	USD	3 783 501	4 562 456	0,18
United States Treasury Bond 3.00% 15 - 15.11.45	2 826 000	USD	2 837 038	3 390 495	0,13
United States Treasury Bond 3.00% 17 - 15.02.47	4 343 000	USD	4 402 501	5 265 498	0,21
United States Treasury Bond 3.00% 17 - 15.05.47	4 253 200	USD	4 176 663	5 160 174	0,20

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 3.00% 18 - 15.02.48	4 956 000	USD	4 746 080	6 039 732	0,24
United States Treasury Bond 3.00% 18 - 15.08.48	5 569 000	USD	5 636 256	6 818 541	0,27
United States Treasury Bond 3.00% 18 - 30.09.25	3 490 000	USD	3 184 227	3 539 931	0,14
United States Treasury Bond 3.00% 18 - 31.10.25	3 226 000	USD	2 952 528	3 277 091	0,13
United States Treasury Bond 3.00% 19 - 15.02.49	6 017 000	USD	6 162 887	7 396 359	0,29
United States Treasury Bond 3.125% 11 - 15.11.41	1 672 000	USD	1 789 675	2 014 822	0,08
United States Treasury Bond 3.125% 12 - 15.02.42	1 945 000	USD	1 948 659	2 349 480	0,09
United States Treasury Bond 3.125% 13 - 15.02.43	2 868 000	USD	2 873 856	3 461 233	0,14
United States Treasury Bond 3.125% 14 - 15.08.44	4 171 000	USD	4 064 553	5 063 927	0,20
United States Treasury Bond 3.125% 18 - 15.05.48	5 288 000	USD	5 576 293	6 597 347	0,26
United States Treasury Bond 3.125% 18 - 15.11.28	8 240 000	USD	7 976 460	8 869 151	0,35
United States Treasury Bond 3.375% 14 - 15.05.44	3 862 000	USD	4 216 170	4 863 390	0,19
United States Treasury Bond 3.375% 18 - 15.11.48	6 008 000	USD	6 242 410	7 858 369	0,31
United States Treasury Bond 3.50% 09 - 15.02.39	1 143 000	USD	1 231 370	1 439 690	0,06
United States Treasury Bond 3.625% 13 - 15.08.43	3 216 000	USD	3 441 641	4 181 870	0,16
United States Treasury Bond 3.625% 14 - 15.02.44	4 251 000	USD	4 683 166	5 541 908	0,22
United States Treasury Bond 3.75% 11 - 15.08.41	1 639 000	USD	1 863 062	2 149 714	0,08
United States Treasury Bond 3.75% 13 - 15.11.43	3 184 000	USD	3 473 383	4 219 104	0,16
United States Treasury Bond 3.875% 10 - 15.08.40	1 644 000	USD	1 800 072	2 181 202	0,09
United States Treasury Bond 4.25% 09 - 15.05.39	1 441 000	USD	1 762 574	1 982 433	0,08
United States Treasury Bond 4.25% 10 - 15.11.40	1 429 000	USD	1 573 359	1 987 196	0,08
United States Treasury Bond 4.375% 08 - 15.02.38	800 000	USD	831 074	1 107 043	0,04
United States Treasury Bond 4.375% 09 - 15.11.39	1 652 000	USD	2 005 783	2 312 703	0,09
United States Treasury Bond 4.375% 10 - 15.05.40	1 623 000	USD	1 936 462	2 282 716	0,09
United States Treasury Bond 4.375% 11 - 15.05.41	1 615 000	USD	1 973 930	2 286 293	0,09
United States Treasury Bond 4.50% 06 - 15.02.36	1 056 000	USD	1 259 523	1 439 848	0,06
United States Treasury Bond 4.50% 08 - 15.05.38	898 000	USD	1 077 663	1 261 270	0,05
United States Treasury Bond 4.50% 09 - 15.08.39	1 556 000	USD	1 901 252	2 205 799	0,09
United States Treasury Bond 4.625% 10 - 15.02.40	1 714 000	USD	2 157 246	2 474 610	0,10
United States Treasury Bond 4.75% 11 - 15.02.41	1 692 000	USD	2 210 226	2 498 869	0,10
United States Treasury Bond 5.00% 07 - 15.05.37	818 000	USD	1 005 845	1 194 654	0,05
United States Treasury Bond 5.25% 98 - 15.11.28	1 058 000	USD	1 125 906	1 303 336	0,05
United States Treasury Bond 5.25% 99 - 15.02.29	670 000	USD	779 716	831 423	0,03
United States Treasury Bond 5.375% 01 - 15.02.31	1 027 000	USD	1 228 917	1 358 444	0,05
United States Treasury Bond 5.50% 98 - 15.08.28	758 000	USD	848 643	940 625	0,04
United States Treasury Bond 6.00% 96 - 15.02.26	980 000	USD	992 935	1 145 626	0,04
United States Treasury Bond 6.125% 97 - 15.11.27	997 000	USD	1 192 052	1 250 245	0,05
United States Treasury Bond 6.25% 93 - 15.08.23	812 000	USD	809 909	859 201	0,03
United States Treasury Bond 6.25% 00 - 15.05.30	983 000	USD	1 198 728	1 347 697	0,05
United States Treasury Bond 8.00% 91 - 15.11.21	1 134 000	USD	1 131 381	1 117 410	0,04
			888 646 926	952 577 369	37,20
Total - Obligations			2 415 354 605	2 526 114 715	98,65
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			2 415 354 605	2 526 114 715	98,65

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations					
Canada					
Canada 0.25% 20 - 08.01.22	1 400 000	CAD	909 629	914 224	0,04
			909 629	914 224	0,04
Total - Obligations			909 629	914 224	0,04
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			909 629	914 224	0,04
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			2 416 264 234	2 527 028 939	98,69
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				2 540 745 537	99,22

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en SGD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Singapour					
Singapore 1.25% 16 - 10.01.21	9 255 000	SGD	9 198 363	9 365 134	6,85
Singapore 1.75% 17 - 04.01.22	5 736 000	SGD	5 767 985	5 882 842	4,31
Singapore 1.75% 18 - 02.01.23	7 391 000	SGD	7 443 471	7 659 293	5,61
Singapore 1.875% 20 - 03.01.50	2 316 000	SGD	2 666 158	2 643 714	1,93
Singapore 2.00% 19 - 02.01.24	2 978 000	SGD	2 975 999	3 147 150	2,30
Singapore 2.125% 16 - 06.01.26	5 736 000	SGD	5 731 675	6 232 164	4,56
Singapore 2.25% 11 - 06.01.21	8 234 000	SGD	8 254 332	8 379 742	6,13
Singapore 2.25% 16 - 08.01.36	4 743 000	SGD	4 564 621	5 445 438	3,99
Singapore 2.375% 15 - 06.01.25	3 971 000	SGD	3 990 728	4 324 816	3,17
Singapore 2.375% 19 - 07.01.39	1 875 000	SGD	1 930 746	2 221 688	1,63
Singapore 2.625% 18 - 05.01.28	5 405 000	SGD	5 527 698	6 140 621	4,49
Singapore 2.75% 12 - 04.01.42	5 074 000	SGD	5 074 808	6 450 576	4,72
Singapore 2.75% 13 - 07.01.23	8 604 000	SGD	8 751 096	9 213 163	6,74
Singapore 2.75% 16 - 03.01.46	7 500 000	SGD	7 555 700	9 768 000	7,15
Singapore 2.875% 10 - 09.01.30	4 302 000	SGD	4 437 432	5 089 266	3,72
Singapore 2.875% 14 - 07.01.29	7 611 000	SGD	8 280 851	8 905 631	6,52
Singapore 3.00% 09 - 09.01.24	8 714 000	SGD	9 032 667	9 630 713	7,05
Singapore 3.125% 07 - 09.01.22	6 177 000	SGD	6 321 740	6 551 944	4,80
Singapore 3.375% 13 - 09.01.33	6 949 000	SGD	7 548 160	8 874 568	6,49
Singapore 3.50% 07 - 03.01.27	8 273 000	SGD	8 856 126	9 762 140	7,14
			123 910 356	135 688 603	99,30
Total - Obligations			123 910 356	135 688 603	99,30
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			123 910 356	135 688 603	99,30
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			123 910 356	135 688 603	99,30
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				136 654 119	100,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
États-Unis					
United States Treasury Bond 0.125% 20 - 30.04.22	4 450 000	USD	4 445 229	4 446 176	0,35
United States Treasury Bond 0.125% 20 - 15.05.23	4 550 000	USD	4 541 540	4 542 535	0,36
United States Treasury Bond 0.25% 20 - 15.04.23	4 317 000	USD	4 318 760	4 325 769	0,34
United States Treasury Bond 0.375% 20 - 31.03.22	4 336 000	USD	4 349 829	4 350 905	0,34
United States Treasury Bond 0.375% 20 - 30.04.25	4 687 000	USD	4 692 800	4 709 336	0,37
United States Treasury Bond 0.50% 20 - 15.03.23	4 265 000	USD	4 293 965	4 301 986	0,34
United States Treasury Bond 0.50% 20 - 31.03.25	4 380 000	USD	4 411 475	4 427 564	0,35
United States Treasury Bond 0.50% 20 - 30.04.27	3 804 000	USD	3 797 499	3 810 241	0,30
United States Treasury Bond 0.625% 20 - 31.03.27	3 606 000	USD	3 630 912	3 643 187	0,29
United States Treasury Bond 0.625% 20 - 15.05.30	3 462 000	USD	3 453 495	3 451 722	0,27
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 30.06.21	3 643 000	USD	3 621 352	3 677 723	0,29
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 31.07.21	3 744 000	USD	3 713 602	3 782 610	0,30
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 31.08.21	3 682 200	USD	3 668 046	3 722 474	0,29
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 30.09.21	3 810 000	USD	3 776 176	3 855 541	0,30
United States Treasury Bond 1.125% 20 - 28.02.22	4 467 000	USD	4 535 990	4 536 797	0,36
United States Treasury Bond 1.125% 20 - 28.02.25	4 560 000	USD	4 728 663	4 743 469	0,38
United States Treasury Bond 1.125% 20 - 28.02.27	3 589 000	USD	3 729 675	3 745 177	0,30
United States Treasury Bond 1.25% 16 - 31.07.23	3 105 000	USD	3 104 924	3 206 883	0,25
United States Treasury Bond 1.25% 16 - 31.10.21	3 689 000	USD	3 657 872	3 742 029	0,30
United States Treasury Bond 1.25% 19 - 31.08.24	4 407 000	USD	4 377 137	4 591 543	0,36
United States Treasury Bond 1.25% 20 - 15.05.50	2 382 000	USD	2 291 251	2 289 325	0,18
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 31.05.21	3 544 000	USD	3 541 217	3 582 763	0,28
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 30.06.23	3 128 000	USD	3 095 479	3 239 435	0,26
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 31.08.23	3 091 000	USD	3 083 618	3 207 154	0,25
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 30.09.23	2 958 000	USD	2 947 304	3 072 160	0,24
United States Treasury Bond 1.375% 19 - 31.08.26	3 639 000	USD	3 642 807	3 851 654	0,30
United States Treasury Bond 1.375% 19 - 15.10.22	4 228 000	USD	4 238 571	4 343 610	0,34
United States Treasury Bond 1.375% 20 - 31.01.22	4 333 000	USD	4 354 579	4 413 905	0,35
United States Treasury Bond 1.375% 20 - 31.01.25	4 363 800	USD	4 412 195	4 585 399	0,36
United States Treasury Bond 1.375% 20 - 15.02.23	4 078 000	USD	4 134 531	4 205 756	0,33
United States Treasury Bond 1.50% 15 - 31.01.22	3 169 000	USD	3 162 285	3 234 361	0,26
United States Treasury Bond 1.50% 16 - 28.02.23	3 202 400	USD	3 172 226	3 315 235	0,26
United States Treasury Bond 1.50% 16 - 31.03.23	3 036 500	USD	3 019 505	3 146 810	0,25
United States Treasury Bond 1.50% 16 - 15.08.26	6 889 600	USD	6 786 684	7 342 268	0,58
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 15.08.22	4 114 000	USD	4 131 117	4 230 349	0,33
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 31.08.21	4 294 000	USD	4 300 029	4 359 752	0,34
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 15.09.22	4 113 000	USD	4 127 376	4 234 783	0,33
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.09.21	4 337 000	USD	4 351 537	4 408 493	0,35
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.09.24	4 570 000	USD	4 610 170	4 812 781	0,38
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 31.10.21	4 452 000	USD	4 470 226	4 530 954	0,36
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 31.10.24	4 419 000	USD	4 480 133	4 657 212	0,37
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.11.21	4 359 000	USD	4 355 106	4 440 731	0,35
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.11.24	4 377 000	USD	4 394 252	4 616 709	0,36
United States Treasury Bond 1.50% 20 - 15.01.23	4 343 000	USD	4 384 500	4 488 219	0,35
United States Treasury Bond 1.50% 20 - 31.01.27	3 629 000	USD	3 702 747	3 874 808	0,31
United States Treasury Bond 1.50% 20 - 15.02.30	8 270 000	USD	8 801 932	8 941 292	0,71
United States Treasury Bond 1.625% 12 - 15.08.22	7 153 000	USD	7 172 163	7 373 737	0,58
United States Treasury Bond 1.625% 12 - 15.11.22	11 354 000	USD	11 386 369	11 743 407	0,93

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 15.02.26	6 974 800	USD	6 915 356	7 461 401	0,59
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 30.04.23	3 034 000	USD	3 015 297	3 157 493	0,25
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 15.05.26	6 790 000	USD	6 757 506	7 278 031	0,58
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 31.05.23	3 021 000	USD	3 009 733	3 147 977	0,25
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 31.10.23	3 048 000	USD	3 041 738	3 193 018	0,25
United States Treasury Bond 1.625% 17 - 31.08.22	3 690 000	USD	3 695 782	3 805 889	0,30
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 30.06.21	4 415 000	USD	4 434 885	4 479 156	0,35
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 15.08.29	8 251 000	USD	8 412 220	9 003 259	0,71
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 30.09.26	3 473 000	USD	3 535 713	3 730 490	0,29
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 31.10.26	3 416 000	USD	3 453 275	3 668 998	0,29
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 30.11.26	3 621 000	USD	3 634 479	3 891 726	0,31
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 15.12.22	4 098 000	USD	4 130 174	4 243 991	0,34
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 31.12.21	4 394 000	USD	4 415 419	4 489 089	0,35
United States Treasury Bond 1.75% 12 - 15.05.22	7 291 000	USD	7 334 507	7 506 313	0,59
United States Treasury Bond 1.75% 13 - 15.05.23	7 291 300	USD	7 336 968	7 619 408	0,60
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 28.02.22	3 076 500	USD	3 089 625	3 156 297	0,25
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 31.03.22	3 231 000	USD	3 233 681	3 319 600	0,26
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 30.04.22	2 999 000	USD	3 003 345	3 085 690	0,24
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 30.09.22	3 149 900	USD	3 137 490	3 261 131	0,26
United States Treasury Bond 1.75% 16 - 31.01.23	3 308 000	USD	3 322 737	3 441 871	0,27
United States Treasury Bond 1.75% 16 - 30.11.21	3 803 400	USD	3 817 326	3 888 382	0,31
United States Treasury Bond 1.75% 17 - 31.05.22	3 693 000	USD	3 726 015	3 804 367	0,30
United States Treasury Bond 1.75% 17 - 30.06.22	3 731 000	USD	3 728 375	3 848 468	0,30
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 15.06.22	4 080 000	USD	4 117 271	4 206 225	0,33
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 30.06.24	4 427 000	USD	4 467 111	4 695 387	0,37
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 15.07.22	4 272 000	USD	4 325 691	4 409 171	0,35
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.07.21	4 458 000	USD	4 482 665	4 533 926	0,36
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.07.24	4 407 000	USD	4 453 049	4 678 995	0,37
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 15.11.29	8 296 000	USD	8 501 097	9 160 599	0,72
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.12.24	4 483 000	USD	4 582 150	4 782 801	0,38
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.12.26	3 416 000	USD	3 470 077	3 700 222	0,29
United States Treasury Bond 1.875% 14 - 30.11.21	3 044 000	USD	3 056 773	3 117 246	0,25
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.05.22	3 092 000	USD	3 103 700	3 192 731	0,25
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.08.22	3 178 000	USD	3 218 055	3 294 941	0,26
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.10.22	3 096 000	USD	3 119 334	3 218 631	0,25
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.01.22	3 882 000	USD	3 905 467	3 985 116	0,32
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 28.02.22	3 828 000	USD	3 843 202	3 935 364	0,31
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.03.22	3 876 000	USD	3 913 707	3 990 766	0,32
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 30.04.22	3 797 000	USD	3 810 250	3 914 766	0,31
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.07.22	3 666 000	USD	3 675 026	3 796 029	0,30
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.08.24	3 189 000	USD	3 211 940	3 405 752	0,27
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 30.09.22	3 849 000	USD	3 884 661	3 996 645	0,32
United States Treasury Bond 1.875% 19 - 30.06.26	3 416 000	USD	3 507 745	3 714 900	0,29
United States Treasury Bond 1.875% 19 - 31.07.26	3 470 000	USD	3 513 074	3 776 065	0,30
United States Treasury Bond 2.00% 11 - 15.11.21	7 278 000	USD	7 319 653	7 461 088	0,59
United States Treasury Bond 2.00% 12 - 15.02.22	7 203 000	USD	7 234 010	7 414 588	0,59
United States Treasury Bond 2.00% 13 - 15.02.23	7 160 200	USD	7 236 574	7 501 988	0,59
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.05.21	3 083 700	USD	3 091 068	3 134 774	0,25

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.08.21	3 126 000	USD	3 124 458	3 192 428	0,25
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.10.21	3 135 000	USD	3 151 275	3 211 416	0,25
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 15.02.25	7 074 300	USD	7 137 281	7 638 586	0,60
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 31.07.22	3 313 000	USD	3 339 411	3 439 567	0,27
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 15.08.25	7 266 200	USD	7 400 792	7 887 233	0,62
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 30.11.22	7 002 000	USD	7 102 221	7 309 432	0,58
United States Treasury Bond 2.00% 16 - 15.11.26	6 834 000	USD	6 951 553	7 503 519	0,59
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 31.12.21	3 872 000	USD	3 895 303	3 977 572	0,31
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 30.04.24	3 079 000	USD	3 118 837	3 288 276	0,26
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 31.05.24	7 908 000	USD	8 031 838	8 456 000	0,67
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 30.06.24	3 094 000	USD	3 150 617	3 312 272	0,26
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 31.10.22	3 687 000	USD	3 728 552	3 843 698	0,30
United States Treasury Bond 2.00% 20 - 15.02.50	5 689 000	USD	6 484 702	6 516 127	0,52
United States Treasury Bond 2.125% 11 - 15.08.21	7 248 000	USD	7 294 637	7 405 418	0,59
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 30.06.21	3 391 200	USD	3 408 947	3 457 169	0,27
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 30.09.21	3 249 400	USD	3 272 092	3 328 604	0,26
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 31.12.21	3 116 400	USD	3 130 057	3 206 970	0,25
United States Treasury Bond 2.125% 15 - 15.05.25	7 157 200	USD	7 288 545	7 795 197	0,62
United States Treasury Bond 2.125% 15 - 30.06.22	3 103 600	USD	3 148 072	3 224 834	0,25
United States Treasury Bond 2.125% 15 - 31.12.22	6 839 000	USD	6 906 544	7 170 798	0,57
United States Treasury Bond 2.125% 16 - 30.11.23	3 034 000	USD	3 078 171	3 232 632	0,26
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 29.02.24	2 968 000	USD	3 003 962	3 175 760	0,25
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 31.03.24	8 091 000	USD	8 212 946	8 667 484	0,69
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 31.07.24	3 231 000	USD	3 339 317	3 479 383	0,28
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 30.09.24	3 153 000	USD	3 210 450	3 403 516	0,27
United States Treasury Bond 2.125% 17 - 30.11.24	3 127 000	USD	3 211 590	3 384 000	0,27
United States Treasury Bond 2.125% 19 - 15.05.22	4 122 000	USD	4 173 305	4 272 389	0,34
United States Treasury Bond 2.125% 19 - 31.05.21	4 173 000	USD	4 203 906	4 247 332	0,34
United States Treasury Bond 2.125% 19 - 31.05.26	3 584 000	USD	3 740 250	3 947 440	0,31
United States Treasury Bond 2.25% 14 - 31.07.21	3 148 000	USD	3 165 907	3 218 584	0,25
United States Treasury Bond 2.25% 14 - 15.11.24	7 221 700	USD	7 376 677	7 849 085	0,62
United States Treasury Bond 2.25% 15 - 15.11.25	7 307 100	USD	7 544 601	8 050 369	0,64
United States Treasury Bond 2.25% 16 - 15.08.46	4 229 600	USD	4 069 484	5 018 685	0,40
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 31.12.23	3 037 000	USD	3 113 191	3 253 861	0,26
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 31.01.24	3 070 000	USD	3 102 700	3 294 254	0,26
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 15.02.27	6 839 000	USD	7 043 747	7 640 445	0,60
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 15.08.27	6 884 000	USD	7 115 820	7 732 668	0,61
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 31.10.24	3 159 000	USD	3 251 207	3 431 217	0,27
United States Treasury Bond 2.25% 17 - 15.11.27	6 874 000	USD	7 075 302	7 741 842	0,61
United States Treasury Bond 2.25% 18 - 31.12.24	3 026 000	USD	3 077 293	3 296 212	0,26
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 31.03.26	3 416 000	USD	3 484 744	3 780 818	0,30
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 15.04.22	4 200 000	USD	4 251 285	4 355 531	0,34
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 30.04.24	4 452 000	USD	4 585 558	4 797 030	0,38
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 15.08.49	5 579 000	USD	5 979 812	6 710 927	0,53
United States Treasury Bond 2.375% 14 - 15.08.24	7 135 500	USD	7 342 602	7 762 086	0,61
United States Treasury Bond 2.375% 17 - 15.05.27	6 844 000	USD	7 095 685	7 725 700	0,61
United States Treasury Bond 2.375% 18 - 31.01.23	3 643 000	USD	3 710 798	3 849 342	0,30
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 29.02.24	4 440 000	USD	4 524 643	4 791 038	0,38

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 15.03.22	4 119 000	USD	4 172 441	4 272 819	0,34
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 30.04.26	3 565 000	USD	3 715 759	3 975 253	0,31
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 15.05.29	8 170 000	USD	8 682 448	9 429 968	0,75
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 15.11.49	5 723 000	USD	6 254 646	7 070 587	0,56
United States Treasury Bond 2.50% 13 - 15.08.23	7 081 200	USD	7 257 471	7 591 821	0,60
United States Treasury Bond 2.50% 14 - 15.05.24	7 376 000	USD	7 603 968	8 024 281	0,63
United States Treasury Bond 2.50% 15 - 15.02.45	4 655 800	USD	4 788 324	5 743 730	0,45
United States Treasury Bond 2.50% 16 - 15.02.46	4 193 900	USD	4 290 912	5 196 177	0,41
United States Treasury Bond 2.50% 16 - 15.05.46	4 351 700	USD	4 662 652	5 400 188	0,43
United States Treasury Bond 2.50% 18 - 31.01.25	3 014 000	USD	3 088 838	3 321 522	0,26
United States Treasury Bond 2.50% 18 - 31.03.23	3 797 000	USD	3 917 269	4 038 465	0,32
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 15.01.22	4 230 000	USD	4 299 115	4 379 702	0,35
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 31.01.24	4 374 000	USD	4 533 783	4 731 780	0,37
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 15.02.22	4 021 000	USD	4 081 327	4 171 473	0,33
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 28.02.26	3 348 000	USD	3 460 415	3 748 452	0,30
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 28.02.23	3 745 000	USD	3 846 147	3 988 717	0,32
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 31.03.25	3 114 000	USD	3 238 705	3 459 459	0,27
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.06.21	3 440 000	USD	3 473 426	3 520 356	0,28
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 30.06.23	3 904 000	USD	4 030 789	4 188 565	0,33
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.07.21	3 514 000	USD	3 554 847	3 603 497	0,28
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.12.21	4 098 000	USD	4 174 725	4 243 991	0,34
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 31.12.23	4 478 000	USD	4 626 685	4 856 881	0,38
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 31.12.25	3 582 000	USD	3 746 720	4 025 273	0,32
United States Treasury Bond 2.625% 19 - 31.01.26	3 608 000	USD	3 831 602	4 059 282	0,32
United States Treasury Bond 2.625% 19 - 15.02.29	8 364 000	USD	8 980 993	9 803 523	0,77
United States Treasury Bond 2.75% 12 - 15.08.42	4 552 700	USD	5 010 553	5 838 838	0,46
United States Treasury Bond 2.75% 12 - 15.11.42	4 706 000	USD	5 058 113	6 029 562	0,48
United States Treasury Bond 2.75% 13 - 15.11.23	7 184 000	USD	7 434 587	7 800 252	0,62
United States Treasury Bond 2.75% 14 - 15.02.24	7 271 400	USD	7 568 405	7 938 892	0,63
United States Treasury Bond 2.75% 17 - 15.08.47	4 213 000	USD	4 785 608	5 507 510	0,44
United States Treasury Bond 2.75% 17 - 15.11.47	4 320 000	USD	4 672 452	5 654 813	0,45
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 15.02.28	7 167 000	USD	7 712 080	8 360 753	0,66
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 28.02.25	3 147 000	USD	3 348 269	3 509 151	0,28
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 30.04.23	3 959 000	USD	4 104 400	4 246 028	0,34
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 31.05.23	3 903 000	USD	4 017 947	4 194 200	0,33
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 30.06.25	3 254 000	USD	3 429 496	3 650 835	0,29
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 31.07.23	3 988 000	USD	4 156 092	4 302 055	0,34
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 15.08.21	3 838 000	USD	3 873 807	3 948 343	0,31
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 31.08.23	4 178 000	USD	4 354 061	4 515 831	0,36
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 31.08.25	3 368 000	USD	3 516 932	3 787 684	0,30
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 15.09.21	4 010 000	USD	4 071 961	4 134 686	0,33
United States Treasury Bond 2.875% 13 - 15.05.43	4 532 000	USD	5 066 732	5 923 466	0,47
United States Treasury Bond 2.875% 15 - 15.08.45	4 683 800	USD	5 310 917	6 177 127	0,49
United States Treasury Bond 2.875% 16 - 15.11.46	4 320 000	USD	4 980 921	5 748 300	0,45
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 30.04.25	3 324 000	USD	3 535 576	3 738 461	0,30
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.05.28	7 537 000	USD	7 963 466	8 896 015	0,70
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 31.05.25	3 330 000	USD	3 557 653	3 751 193	0,30
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 31.07.25	3 235 000	USD	3 354 595	3 653 023	0,29

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.08.28	7 861 000	USD	8 569 326	9 310 986	0,74
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 30.09.23	4 077 000	USD	4 190 733	4 430 871	0,35
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.10.21	3 910 000	USD	3 976 182	4 045 934	0,32
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 31.10.23	4 220 000	USD	4 391 616	4 595 514	0,36
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.11.21	3 993 000	USD	4 054 535	4 140 866	0,33
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 30.11.23	4 518 000	USD	4 694 900	4 929 208	0,39
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 30.11.25	3 462 800	USD	3 651 037	3 933 254	0,31
United States Treasury Bond 2.875% 19 - 15.05.49	5 635 000	USD	6 660 277	7 625 740	0,60
United States Treasury Bond 3.00% 12 - 15.05.42	4 481 000	USD	5 021 511	5 969 532	0,47
United States Treasury Bond 3.00% 14 - 15.11.44	4 534 300	USD	5 189 220	6 073 482	0,48
United States Treasury Bond 3.00% 15 - 15.05.45	4 626 700	USD	5 296 657	6 212 429	0,49
United States Treasury Bond 3.00% 15 - 15.11.45	4 590 300	USD	5 332 883	6 186 864	0,49
United States Treasury Bond 3.00% 17 - 15.02.47	4 294 000	USD	4 872 559	5 851 582	0,46
United States Treasury Bond 3.00% 17 - 15.05.47	4 270 000	USD	4 954 518	5 823 546	0,46
United States Treasury Bond 3.00% 18 - 15.02.48	4 612 000	USD	5 359 049	6 316 999	0,50
United States Treasury Bond 3.00% 18 - 15.08.48	5 147 000	USD	5 922 374	7 080 342	0,56
United States Treasury Bond 3.00% 18 - 30.09.25	3 517 000	USD	3 779 785	4 006 633	0,32
United States Treasury Bond 3.00% 18 - 31.10.25	3 344 700	USD	3 546 557	3 815 310	0,30
United States Treasury Bond 3.00% 19 - 15.02.49	5 595 000	USD	6 294 551	7 727 220	0,61
United States Treasury Bond 3.125% 11 - 15.11.41	4 584 000	USD	5 254 634	6 209 529	0,49
United States Treasury Bond 3.125% 12 - 15.02.42	4 615 800	USD	5 291 989	6 265 228	0,50
United States Treasury Bond 3.125% 13 - 15.02.43	4 614 200	USD	5 440 833	6 257 288	0,49
United States Treasury Bond 3.125% 14 - 15.08.44	4 590 000	USD	5 375 141	6 262 123	0,50
United States Treasury Bond 3.125% 18 - 15.05.48	4 507 000	USD	5 306 641	6 318 251	0,50
United States Treasury Bond 3.125% 18 - 15.11.28	8 185 500	USD	8 993 308	9 899 978	0,78
United States Treasury Bond 3.375% 14 - 15.05.44	4 660 600	USD	5 688 404	6 594 021	0,52
United States Treasury Bond 3.375% 18 - 15.11.48	5 521 800	USD	6 663 004	8 116 615	0,64
United States Treasury Bond 3.50% 09 - 15.02.39	2 806 000	USD	3 355 088	3 972 463	0,31
United States Treasury Bond 3.625% 13 - 15.08.43	4 518 000	USD	5 704 216	6 601 575	0,52
United States Treasury Bond 3.625% 14 - 15.02.44	4 632 900	USD	5 944 452	6 783 941	0,54
United States Treasury Bond 3.75% 11 - 15.08.41	4 734 700	USD	6 009 239	6 979 613	0,55
United States Treasury Bond 3.75% 13 - 15.11.43	4 547 000	USD	5 753 724	6 770 057	0,54
United States Treasury Bond 3.875% 10 - 15.08.40	4 763 200	USD	6 001 164	7 101 261	0,56
United States Treasury Bond 4.25% 09 - 15.05.39	4 320 000	USD	5 802 561	6 678 450	0,53
United States Treasury Bond 4.25% 10 - 15.11.40	4 620 700	USD	6 237 291	7 223 454	0,57
United States Treasury Bond 4.375% 08 - 15.02.38	2 481 000	USD	3 397 660	3 857 761	0,30
United States Treasury Bond 4.375% 09 - 15.11.39	4 878 000	USD	6 696 350	7 674 847	0,61
United States Treasury Bond 4.375% 10 - 15.05.40	4 768 800	USD	6 432 036	7 538 802	0,60
United States Treasury Bond 4.375% 11 - 15.05.41	4 610 700	USD	6 416 188	7 336 056	0,58
United States Treasury Bond 4.50% 06 - 15.02.36	2 830 300	USD	3 757 091	4 333 897	0,34
United States Treasury Bond 4.50% 08 - 15.05.38	2 858 700	USD	3 949 864	4 512 279	0,36
United States Treasury Bond 4.50% 09 - 15.08.39	4 505 400	USD	6 226 569	7 179 778	0,57
United States Treasury Bond 4.625% 10 - 15.02.40	4 876 000	USD	6 891 766	7 912 834	0,63
United States Treasury Bond 4.75% 07 - 15.02.37	1 801 000	USD	2 507 464	2 873 158	0,23
United States Treasury Bond 4.75% 11 - 15.02.41	4 781 900	USD	7 006 585	7 937 581	0,63
United States Treasury Bond 5.00% 07 - 15.05.37	2 370 600	USD	3 419 211	3 889 080	0,31
United States Treasury Bond 5.25% 98 - 15.11.28	1 161 000	USD	1 442 042	1 608 076	0,13
United States Treasury Bond 5.25% 99 - 15.02.29	1 231 000	USD	1 555 161	1 717 726	0,14

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 5.375% 01 - 15.02.31	1 794 300	USD	2 379 894	2 665 657	0,21
United States Treasury Bond 5.50% 98 - 15.08.28	1 282 000	USD	1 651 522	1 789 191	0,14
United States Treasury Bond 6.00% 96 - 15.02.26	1 370 000	USD	1 694 596	1 800 694	0,14
United States Treasury Bond 6.125% 97 - 15.11.27	2 565 800	USD	3 348 799	3 618 580	0,29
United States Treasury Bond 6.125% 99 - 15.08.29	1 166 000	USD	1 556 341	1 742 532	0,14
United States Treasury Bond 6.25% 93 - 15.08.23	2 531 800	USD	2 854 166	3 011 260	0,24
United States Treasury Bond 6.25% 00 - 15.05.30	1 864 700	USD	2 569 956	2 873 532	0,23
United States Treasury Bond 6.375% 97 - 15.08.27	982 000	USD	1 304 257	1 389 530	0,11
United States Treasury Bond 6.50% 96 - 15.11.26	1 156 300	USD	1 480 922	1 600 120	0,13
United States Treasury Bond 6.625% 97 - 15.02.27	1 048 300	USD	1 352 819	1 472 616	0,12
United States Treasury Bond 6.75% 96 - 15.08.26	960 000	USD	1 266 221	1 330 425	0,11
United States Treasury Bond 6.875% 95 - 15.08.25	1 199 000	USD	1 487 762	1 600 197	0,13
United States Treasury Bond 7.125% 93 - 15.02.23	1 734 000	USD	1 989 385	2 050 997	0,16
United States Treasury Bond 7.25% 92 - 15.08.22	1 118 900	USD	1 246 573	1 286 997	0,10
United States Treasury Bond 7.50% 94 - 15.11.24	1 201 100	USD	1 522 933	1 580 103	0,12
United States Treasury Bond 7.625% 92 - 15.11.22	795 000	USD	896 661	935 616	0,07
United States Treasury Bond 7.625% 95 - 15.02.25	1 118 000	USD	1 420 582	1 496 810	0,12
United States Treasury Bond 8.00% 91 - 15.11.21	3 535 600	USD	3 825 228	3 915 677	0,31
United States Treasury Bond 8.125% 91 - 15.08.21	989 000	USD	1 053 240	1 077 701	0,09
			1 163 152 966	1 246 805 285	98,55
Total - Obligations			1 163 152 966	1 246 805 285	98,55
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 163 152 966	1 246 805 285	98,55
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 163 152 966	1 246 805 285	98,55
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 252 927 439	99,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
États-Unis					
United States Treasury Bond 0.125% 20 - 30.04.22	977 000	USD	975 914	976 160	1,11
United States Treasury Bond 0.125% 20 - 15.05.23	1 019 000	USD	1 017 144	1 017 328	1,16
United States Treasury Bond 0.25% 20 - 15.04.23	926 000	USD	926 448	927 881	1,05
United States Treasury Bond 0.375% 20 - 31.03.22	983 000	USD	985 995	986 379	1,12
United States Treasury Bond 0.50% 20 - 15.03.23	980 000	USD	986 837	988 498	1,12
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 30.06.21	821 000	USD	813 870	828 825	0,94
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 31.07.21	794 000	USD	788 984	802 188	0,91
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 31.08.21	873 000	USD	862 730	882 548	1,00
United States Treasury Bond 1.125% 16 - 30.09.21	784 000	USD	774 729	793 371	0,90
United States Treasury Bond 1.125% 20 - 28.02.22	935 000	USD	949 369	949 609	1,08
United States Treasury Bond 1.25% 16 - 31.10.21	872 000	USD	863 237	884 535	1,00
United States Treasury Bond 1.375% 16 - 31.05.21	844 000	USD	839 692	853 231	0,97
United States Treasury Bond 1.375% 19 - 15.10.22	942 000	USD	944 672	967 758	1,10
United States Treasury Bond 1.375% 20 - 31.01.22	984 000	USD	984 768	1 002 373	1,14
United States Treasury Bond 1.375% 20 - 15.02.23	913 000	USD	926 098	941 603	1,07
United States Treasury Bond 1.50% 15 - 31.01.22	673 000	USD	667 003	686 881	0,78
United States Treasury Bond 1.50% 16 - 28.02.23	710 000	USD	733 203	735 016	0,83
United States Treasury Bond 1.50% 16 - 31.03.23	675 000	USD	698 333	699 522	0,79
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 15.08.22	940 000	USD	940 618	966 584	1,10
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 31.08.21	934 000	USD	933 179	948 302	1,08
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 15.09.22	920 000	USD	918 444	947 241	1,08
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.09.21	964 000	USD	963 564	979 891	1,11
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 31.10.21	1 015 000	USD	1 015 768	1 033 000	1,17
United States Treasury Bond 1.50% 19 - 30.11.21	966 000	USD	968 543	984 113	1,12
United States Treasury Bond 1.50% 20 - 15.01.23	913 000	USD	920 202	943 528	1,07
United States Treasury Bond 1.625% 12 - 15.08.22	1 617 000	USD	1 625 580	1 666 900	1,89
United States Treasury Bond 1.625% 12 - 15.11.22	2 486 000	USD	2 496 359	2 571 262	2,92
United States Treasury Bond 1.625% 16 - 30.04.23	720 000	USD	749 247	749 306	0,85
United States Treasury Bond 1.625% 17 - 31.08.22	783 000	USD	786 446	807 591	0,92
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 30.06.21	945 000	USD	945 909	958 732	1,09
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 15.12.22	883 000	USD	886 098	914 457	1,04
United States Treasury Bond 1.625% 19 - 31.12.21	985 000	USD	986 514	1 006 316	1,14
United States Treasury Bond 1.75% 12 - 15.05.22	1 656 000	USD	1 661 104	1 704 904	1,94
United States Treasury Bond 1.75% 13 - 15.05.23	1 564 000	USD	1 633 917	1 634 380	1,86
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 28.02.22	700 000	USD	696 344	718 156	0,82
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 31.03.22	737 000	USD	735 548	757 210	0,86
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 30.04.22	699 000	USD	701 254	719 205	0,82
United States Treasury Bond 1.75% 15 - 30.09.22	703 000	USD	708 416	727 825	0,83
United States Treasury Bond 1.75% 16 - 31.01.23	698 000	USD	713 605	726 247	0,82
United States Treasury Bond 1.75% 16 - 30.11.21	874 000	USD	872 311	893 529	1,01
United States Treasury Bond 1.75% 17 - 31.05.22	880 000	USD	881 355	906 538	1,03
United States Treasury Bond 1.75% 17 - 30.06.22	830 000	USD	830 785	856 132	0,97
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 15.06.22	906 000	USD	912 700	934 029	1,06
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 15.07.22	884 000	USD	884 236	912 385	1,04
United States Treasury Bond 1.75% 19 - 31.07.21	928 000	USD	927 457	943 805	1,07
United States Treasury Bond 1.875% 14 - 30.11.21	702 000	USD	703 981	718 892	0,82
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.05.22	683 000	USD	686 271	705 251	0,80
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.08.22	736 000	USD	742 676	763 083	0,87

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 1.875% 15 - 31.10.22	703 000	USD	709 145	730 845	0,83
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.01.22	788 000	USD	785 042	808 931	0,92
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 28.02.22	812 000	USD	812 527	834 774	0,95
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.03.22	828 000	USD	832 246	852 517	0,97
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 30.04.22	790 000	USD	793 240	814 502	0,93
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 31.07.22	880 000	USD	890 159	911 213	1,03
United States Treasury Bond 1.875% 17 - 30.09.22	872 000	USD	878 908	905 449	1,03
United States Treasury Bond 2.00% 11 - 15.11.21	1 655 000	USD	1 656 531	1 696 634	1,93
United States Treasury Bond 2.00% 12 - 15.02.22	1 560 000	USD	1 560 386	1 605 825	1,82
United States Treasury Bond 2.00% 13 - 15.02.23	1 615 000	USD	1 664 376	1 692 091	1,92
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.05.21	665 000	USD	664 197	676 014	0,77
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.08.21	703 000	USD	702 195	717 939	0,82
United States Treasury Bond 2.00% 14 - 31.10.21	738 000	USD	739 177	755 989	0,86
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 31.07.22	743 000	USD	752 988	771 385	0,88
United States Treasury Bond 2.00% 15 - 30.11.22	1 489 000	USD	1 513 120	1 554 377	1,77
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 31.12.21	786 000	USD	787 899	807 431	0,92
United States Treasury Bond 2.00% 17 - 31.10.22	784 000	USD	791 145	817 320	0,93
United States Treasury Bond 2.125% 11 - 15.08.21	1 673 000	USD	1 677 527	1 709 336	1,94
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 30.06.21	698 000	USD	698 370	711 578	0,81
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 30.09.21	742 000	USD	742 730	760 086	0,86
United States Treasury Bond 2.125% 14 - 31.12.21	664 000	USD	664 767	683 298	0,78
United States Treasury Bond 2.125% 15 - 30.06.22	703 000	USD	710 345	730 461	0,83
United States Treasury Bond 2.125% 15 - 31.12.22	1 545 000	USD	1 579 710	1 619 957	1,84
United States Treasury Bond 2.125% 19 - 15.05.22	975 000	USD	987 181	1 010 572	1,15
United States Treasury Bond 2.125% 19 - 31.05.21	985 000	USD	987 788	1 002 545	1,14
United States Treasury Bond 2.25% 14 - 31.07.21	663 000	USD	665 352	677 866	0,77
United States Treasury Bond 2.25% 19 - 15.04.22	914 000	USD	919 379	947 847	1,08
United States Treasury Bond 2.375% 18 - 31.01.23	840 000	USD	872 084	887 578	1,01
United States Treasury Bond 2.375% 19 - 15.03.22	890 000	USD	895 435	923 236	1,05
United States Treasury Bond 2.50% 18 - 31.03.23	841 000	USD	892 973	894 482	1,02
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 15.01.22	913 000	USD	924 094	945 312	1,07
United States Treasury Bond 2.50% 19 - 15.02.22	913 000	USD	920 602	947 166	1,08
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 28.02.23	862 000	USD	916 000	918 097	1,04
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.06.21	776 000	USD	777 295	794 127	0,90
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.07.21	802 000	USD	803 016	822 426	0,93
United States Treasury Bond 2.625% 18 - 15.12.21	915 000	USD	921 501	947 597	1,08
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 30.04.23	863 000	USD	925 337	925 568	1,05
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 15.08.21	812 000	USD	814 858	835 345	0,95
United States Treasury Bond 2.75% 18 - 15.09.21	905 000	USD	908 175	933 140	1,06
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.10.21	884 000	USD	895 166	914 733	1,04
United States Treasury Bond 2.875% 18 - 15.11.21	890 000	USD	898 085	922 958	1,05
United States Treasury Bond 7.125% 93 - 15.02.23	366 000	USD	425 609	432 909	0,49
United States Treasury Bond 7.25% 92 - 15.08.22	228 000	USD	255 268	262 253	0,30
United States Treasury Bond 7.625% 92 - 15.11.22	221 000	USD	251 877	260 089	0,30

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United States Treasury Bond 8.00% 91 - 15.11.21	790 000	USD	848 509	874 925	0,99
United States Treasury Bond 8.125% 91 - 15.08.21	230 000	USD	243 991	250 628	0,28
			85 723 762	87 521 851	99,44
Total - Obligations			85 723 762	87 521 851	99,44
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			85 723 762	87 521 851	99,44
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			85 723 762	87 521 851	99,44
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				87 889 305	99,85

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Australie					
Amcor Pty Ltd. 2.75% 13 - 22.03.23	200 000	EUR	210 667	210 362	0,01
APT Pipelines Ltd. 1.375% 15 - 22.03.22	569 000	EUR	580 195	576 306	0,03
APT Pipelines Ltd. 2.00% 15 - 22.03.27	510 000	EUR	542 593	539 121	0,02
APT Pipelines Ltd. 2.00% 20 - 15.07.30	578 000	EUR	586 506	609 316	0,03
Aurizon Network Pty Ltd. 2.00% 14 - 18.09.24	500 000	EUR	533 584	524 560	0,02
Aurizon Network Pty Ltd. 3.125% 16 - 06.01.26	550 000	EUR	586 449	606 491	0,03
Ausgrid Finance Pty Ltd. 1.25% 18 - 30.07.25	400 000	EUR	409 367	411 348	0,02
AusNet Services Holdings Pty Ltd. 0.625% 20 - 25.08.30	669 000	EUR	650 561	671 930	0,03
AusNet Services Holdings Pty Ltd. 1.50% 15 - 26.02.27	339 000	EUR	360 693	363 767	0,02
AusNet Services Holdings Pty Ltd. 3.00% 14 - 13.02.24	100 000	EUR	109 406	109 705	0,01
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0.625% 18 - 21.02.23	700 000	EUR	711 592	711 655	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0.75% 16 - 29.09.26	700 000	EUR	713 224	729 064	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 19 - 21.11.29	928 000	EUR	931 597	919 045	0,04
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd. 3.125% 13 - 26.09.23	816 000	EUR	876 765	868 289	0,04
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd. 1.75% 14 - 15.10.24	100 000	EUR	103 919	102 175	0,01
BHP Billiton Finance Ltd. 0.75% 15 - 28.10.22	500 000	EUR	504 704	504 055	0,02
BHP Billiton Finance Ltd. 1.50% 15 - 29.04.30	700 000	EUR	700 988	743 267	0,03
BHP Billiton Finance Ltd. 3.00% 12 - 29.05.24	400 000	EUR	445 967	440 876	0,02
BHP Billiton Finance Ltd. 3.125% 13 - 29.04.33	600 000	EUR	759 902	747 768	0,03
BHP Billiton Finance Ltd. 3.25% 12 - 24.09.27	624 000	EUR	728 565	738 841	0,03
BHP Billiton Finance Ltd. FRN 15 - 22.10.79	400 000	EUR	458 517	463 728	0,02
BHP Billiton Finance Ltd. FRN 15 - 22.10.79	200 000	EUR	235 239	231 864	0,01
Brambles Finance Ltd. 2.375% 14 - 06.12.24	400 000	EUR	426 987	422 632	0,02
Commonwealth Bank of Australia 0.50% 17 - 07.11.22	720 000	EUR	723 973	727 978	0,03
Commonwealth Bank of Australia 1.125% 18 - 18.01.28	300 000	EUR	298 092	322 101	0,01
Commonwealth Bank of Australia FRN 17 - 10.03.29	900 000	EUR	910 446	928 197	0,04
Commonwealth Bank of Australia FRN 15 - 22.04.27	1 500 000	EUR	1 510 278	1 519 905	0,07
Goodman Australia Finance Pty Ltd. 1.375% 17 - 27.09.25	200 000	EUR	199 502	199 996	0,01
Macquarie Bank Ltd. 1.125% 15 - 20.01.22	815 000	EUR	825 701	825 603	0,04
Macquarie Group Ltd. 0.625% 20 - 02.03.27	500 000	EUR	490 483	487 090	0,02
National Australia Bank Ltd. 0.25% 19 - 20.05.24	1 173 000	EUR	1 171 740	1 180 965	0,05
National Australia Bank Ltd. 0.35% 17 - 09.07.22	295 000	EUR	295 970	297 628	0,01
National Australia Bank Ltd. 0.625% 16 - 11.10.23	100 000	EUR	100 557	101 992	0,00
National Australia Bank Ltd. 0.625% 17 - 18.09.24	400 000	EUR	398 530	409 260	0,02
National Australia Bank Ltd. 0.625% 18 - 30.08.23	1 000 000	EUR	1 016 981	1 019 590	0,05
National Australia Bank Ltd. 0.875% 15 - 20.01.22	772 000	EUR	780 754	783 271	0,04
National Australia Bank Ltd. 1.125% 19 - 20.05.31	450 000	EUR	456 484	486 990	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Australie (suite)					
National Australia Bank Ltd. 1.25% 16 - 18.05.26	750 000	EUR	778 538	799 425	0,04
National Australia Bank Ltd. 1.375% 18 - 30.08.28	849 000	EUR	889 451	929 239	0,04
National Australia Bank Ltd. 2.75% 12 - 08.08.22	1 281 000	EUR	1 352 874	1 356 502	0,06
Origin Energy Finance Ltd. 1.00% 19 - 17.09.29	400 000	EUR	385 067	376 356	0,02
Origin Energy Finance Ltd. 3.50% 13 - 10.04.21	600 000	EUR	622 361	620 862	0,03
Scentre Group Trust 1 2.25% 14 - 16.07.24	700 000	EUR	744 656	721 700	0,03
Scentre Group Trust 1 Via Scentre Group Trust 2 1.375% 16 - 22.03.23	400 000	EUR	407 840	400 764	0,02
Scentre Group Trust 1 Via Scentre Group Trust 2 1.45% 19 - 28.03.29	395 000	EUR	392 045	376 676	0,02
Scentre Group Trust 1 Via Scentre Group Trust 2 1.75% 18 - 04.11.28	400 000	EUR	424 868	394 040	0,02
Scentre Group Trust 2 3.25% 13 - 09.11.23	192 000	EUR	211 549	203 282	0,01
Stockland Trust 1.625% 18 - 27.04.26	327 000	EUR	324 499	323 122	0,01
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 18 - 26.04.28	300 000	EUR	298 045	301 692	0,01
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 2.75% 14 - 23.04.24	860 000	EUR	929 516	902 510	0,04
Telstra Corp. Ltd. 1.00% 20 - 23.04.30	899 000	EUR	920 658	925 844	0,04
Telstra Corp. Ltd. 1.125% 16 - 14.04.26	474 000	EUR	493 735	495 472	0,02
Telstra Corp. Ltd. 1.375% 19 - 26.03.29	459 000	EUR	477 133	491 603	0,02
Telstra Corp. Ltd. 2.50% 13 - 15.09.23	1 100 000	EUR	1 176 015	1 179 266	0,05
Telstra Corp. Ltd. 3.50% 12 - 21.09.22	752 000	EUR	809 668	806 264	0,04
Telstra Corp. Ltd. 3.75% 11 - 16.05.22	100 000	EUR	107 002	106 491	0,01
Telstra Corp. Ltd. 3.75% 11 - 16.05.22	100 000	EUR	106 360	106 491	0,01
Toyota Finance Australia Ltd. 0.25% 19 - 04.09.24	1 010 000	EUR	999 107	1 007 990	0,05
Toyota Finance Australia Ltd. 0.50% 18 - 04.06.23	500 000	EUR	504 642	502 715	0,02
Toyota Finance Australia Ltd. 1.584% 20 - 21.04.22	698 000	EUR	711 489	715 178	0,03
Toyota Finance Australia Ltd. 2.004% 20 - 21.10.24	899 000	EUR	951 331	959 458	0,04
Toyota Finance Australia Ltd. 2.28% 20 - 21.10.27	1 007 000	EUR	1 097 010	1 121 103	0,05
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.45% 19 - 16.05.29	840 000	EUR	883 707	833 851	0,04
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 17 - 29.03.28	150 000	EUR	149 078	153 600	0,01
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.875% 14 - 16.09.24	300 000	EUR	309 325	311 316	0,01
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 2.00% 15 - 28.08.25	300 000	EUR	307 080	312 201	0,01
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 3.00% 20 - 04.08.30	778 000	EUR	845 572	857 294	0,04
Vicinity Centres Trust 1.125% 19 - 11.07.29	460 000	EUR	445 136	424 911	0,02
Wesfarmers Ltd. 1.25% 14 - 10.07.21	708 000	EUR	719 633	717 218	0,03
Wesfarmers Ltd. 2.75% 12 - 08.02.22	648 000	EUR	681 533	679 700	0,03
Westpac Banking Corp. 0.25% 16 - 17.01.22	750 000	EUR	753 993	752 873	0,03
Westpac Banking Corp. 0.375% 17 - 03.05.23	650 000	EUR	652 351	656 910	0,03
Westpac Banking Corp. 0.375% 17 - 03.05.23	150 000	EUR	151 741	151 595	0,01
Westpac Banking Corp. 0.625% 17 - 22.11.24	230 000	EUR	231 107	235 269	0,01
Westpac Banking Corp. 0.75% 18 - 17.10.23	950 000	EUR	952 085	972 486	0,04
Westpac Banking Corp. 0.875% 16 - 17.04.27	200 000	EUR	203 901	209 796	0,01
Westpac Banking Corp. 1.125% 17 - 09.05.27	730 000	EUR	759 379	779 246	0,04
Westpac Banking Corp. 1.45% 18 - 17.07.28	700 000	EUR	741 265	771 533	0,03
			46 249 823	46 480 575	2,08

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Autriche					
BAWAG Group AG FRN 19 - 26.03.29	100 000	EUR	101 294	97 260	0,00
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0.375% 19 - 09.03.27	800 000	EUR	732 767	732 200	0,03
Borealis AG 1.75% 18 - 12.10.25	152 000	EUR	162 110	161 281	0,01
CA Immobilien Anlagen AG 0.875% 20 - 02.05.27	500 000	EUR	484 175	471 850	0,02
Erste Group Bank AG 0.375% 19 - 16.04.24	200 000	EUR	201 928	200 948	0,01
Erste Group Bank AG 0.875% 19 - 22.05.26	300 000	EUR	309 216	303 111	0,01
Erste Group Bank AG 0.875% 20 - 13.05.27	1 200 000	EUR	1 221 758	1 234 356	0,06
Erste Group Bank AG FRN 19 - 06.10.30	400 000	EUR	398 170	381 748	0,02
Erste Group Bank AG FRN 19 - 06.10.30	200 000	EUR	188 677	190 874	0,01
IMMOFINANZ AG 2.625% 19 - 27.01.23	600 000	EUR	599 756	601 632	0,03
Mondi Finance Europe GmbH 2.375% 20 - 04.01.28	698 000	EUR	735 413	753 365	0,03
OMV AG Zero Coupon 19 - 07.03.25	721 000	EUR	721 914	711 144	0,03
OMV AG Zero Coupon 20 - 16.06.23	220 000	EUR	219 097	219 192	0,01
OMV AG 0.75% 18 - 12.04.23	505 000	EUR	515 095	514 923	0,02
OMV AG 0.75% 20 - 16.06.30	130 000	EUR	129 344	128 495	0,01
OMV AG 1.00% 17 - 14.12.26	883 000	EUR	892 450	920 201	0,04
OMV AG 1.00% 19 - 07.03.34	548 000	EUR	559 759	536 284	0,02
OMV AG 1.50% 20 - 04.09.24	399 000	EUR	406 663	417 430	0,02
OMV AG 1.875% 18 - 12.04.28	300 000	EUR	319 738	330 090	0,01
OMV AG 2.00% 20 - 04.09.28	699 000	EUR	748 890	773 828	0,03
OMV AG 2.375% 20 - 04.09.32	598 000	EUR	635 352	686 504	0,03
OMV AG 2.625% 12 - 27.09.22	300 000	EUR	317 954	317 223	0,01
OMV AG FRN 18 - 31.12.99	300 000	EUR	319 967	301 215	0,01
OMV AG 3.50% 12 - 27.09.27	700 000	EUR	847 698	849 576	0,04
OMV AG 4.25% 11 - 10.12.21	500 000	EUR	527 275	526 415	0,02
OMV AG FRN 15 - 29.12.49	1 107 000	EUR	1 138 355	1 154 413	0,05
OMV AG FRN 15 - 29.12.49	600 000	EUR	721 611	703 386	0,03
Raiffeisen Bank International AG 0.25% 18 - 07.05.21	200 000	EUR	200 082	199 978	0,01
Raiffeisen Bank International AG 0.25% 20 - 22.01.25	1 300 000	EUR	1 272 876	1 289 002	0,06
Raiffeisen Bank International AG 0.375% 19 - 25.09.26	200 000	EUR	199 348	198 580	0,01
Raiffeisen Bank International AG 1.00% 18 - 12.04.23	500 000	EUR	496 536	508 710	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 19 - 03.12.30	600 000	EUR	570 382	567 558	0,03
Raiffeisen Bank International AG FRN 20 - 18.06.32	200 000	EUR	198 867	202 932	0,01
Raiffeisen Bank International AG 6.00% 13 - 16.10.23	400 000	EUR	469 181	446 936	0,02
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 0.25% 19 - 16.04.24	800 000	EUR	782 288	778 592	0,04
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG 0.75% 17 - 22.05.23	200 000	EUR	199 265	199 262	0,01
Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 16 - 12.07.26	700 000	EUR	739 630	753 585	0,03
Telekom Finanzmanagement GmbH 3.125% 13 - 12.03.21	806 000	EUR	837 466	841 045	0,04
Telekom Finanzmanagement GmbH 3.50% 13 - 07.04.23	200 000	EUR	219 933	219 858	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Autriche (suite)					
Telekom Finanzmanagement GmbH 4.00% 12 - 04.04.22	623 000	EUR	666 017	663 875	0,03
UNIQA Insurance Group AG FRN 15 - 27.07.46	400 000	EUR	456 947	458 688	0,02
UNIQA Insurance Group AG FRN 13 - 31.07.43	300 000	EUR	353 548	335 046	0,02
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 15 - 03.02.46	400 000	EUR	447 164	428 848	0,02
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 13 - 10.09.43	100 000	EUR	112 080	110 777	0,01
Volksbank Wien AG FRN 17 - 10.06.27	600 000	EUR	582 196	572 922	0,03
			22 960 232	22 995 138	1,03
Belgique					
AG Insurance SA FRN 15 - 30.06.47	200 000	EUR	203 539	212 998	0,01
Ageas SA/NV FRN 19 - 07.02.49	100 000	EUR	101 538	103 420	0,00
Ageas SA/NV FRN 19 - 07.02.49	400 000	EUR	422 643	413 680	0,02
Anheuser-Busch InBev SA/NV 0.80% 15 - 20.04.23	261 000	EUR	264 763	265 325	0,01
Anheuser-Busch InBev SA/NV 0.80% 15 - 20.04.23	705 000	EUR	715 660	716 682	0,03
Anheuser-Busch InBev SA/NV 0.875% 16 - 17.03.22	1 569 000	EUR	1 594 451	1 588 267	0,07
Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.125% 19 - 07.01.27	750 000	EUR	765 145	766 185	0,03
Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.125% 19 - 07.01.27	400 000	EUR	415 470	408 632	0,02
Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.15% 18 - 22.01.27	2 328 000	EUR	2 370 091	2 383 872	0,11
Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.50% 15 - 18.04.30	1 050 000	EUR	1 071 151	1 084 576	0,05
Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.50% 16 - 17.03.25	1 714 000	EUR	1 784 464	1 803 437	0,08
Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.65% 19 - 28.03.31	114 000	EUR	114 420	117 657	0,01
Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.65% 19 - 28.03.31	900 000	EUR	921 539	928 872	0,04
Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.95% 14 - 30.09.21	690 000	EUR	706 735	705 732	0,03
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.00% 16 - 17.03.28	954 000	EUR	1 051 182	1 028 660	0,05
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.00% 16 - 17.03.28	1 924 000	EUR	2 065 614	2 074 572	0,09
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.00% 18 - 23.01.35	700 000	EUR	727 187	718 634	0,03
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.125% 20 - 12.02.27	1 309 000	EUR	1 366 885	1 418 014	0,06
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.70% 14 - 31.03.26	850 000	EUR	943 969	953 156	0,04
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.75% 16 - 17.03.36	1 242 000	EUR	1 394 425	1 372 025	0,06
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.75% 16 - 17.03.36	1 297 000	EUR	1 483 217	1 432 783	0,06
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.875% 12 - 25.09.24	1 088 000	EUR	1 200 496	1 197 562	0,05
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.875% 20 - 04.02.32	1 429 000	EUR	1 440 447	1 619 586	0,07
Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.875% 20 - 04.02.32	100 000	EUR	111 264	113 337	0,01
Anheuser-Busch InBev SA/NV 3.25% 13 - 24.01.33	400 000	EUR	483 458	473 512	0,02
Anheuser-Busch InBev SA/NV 3.70% 20 - 04.02.40	1 429 000	EUR	1 470 754	1 735 263	0,08
Anheuser-Busch InBev SA/NV 3.70% 20 - 04.02.40	200 000	EUR	233 078	242 864	0,01
Argenta Spaarbank NV 1.00% 19 - 02.06.24	300 000	EUR	309 867	304 002	0,01
Argenta Spaarbank NV 1.00% 19 - 02.06.24	500 000	EUR	503 466	506 670	0,02
Argenta Spaarbank NV 1.00% 20 - 29.01.27	600 000	EUR	595 869	592 344	0,03
Barry Callebaut Services NV 2.375% 16 - 24.05.24	178 000	EUR	190 912	189 970	0,01
Barry Callebaut Services NV 2.375% 16 - 24.05.24	300 000	EUR	320 150	320 175	0,01
Belfius Bank SA Zero Coupon 19 - 28.08.26	500 000	EUR	488 337	484 280	0,02
Belfius Bank SA 0.375% 19 - 13.02.26	200 000	EUR	198 684	195 666	0,01
Belfius Bank SA 0.375% 19 - 13.02.26	200 000	EUR	197 937	195 666	0,01
Belfius Bank SA 0.625% 18 - 30.08.23	300 000	EUR	301 621	303 369	0,01
Belfius Bank SA 0.75% 17 - 09.12.22	700 000	EUR	700 402	702 583	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Belgique (suite)					
Belfius Bank SA 1.00% 17 - 26.10.24	1 000 000	EUR	987 152	1 016 400	0,05
Belfius Bank SA 3.125% 16 - 05.11.26	200 000	EUR	211 547	220 108	0,01
Brussels Airport Co. NV/SA 1.00% 17 - 05.03.24	800 000	EUR	793 660	790 432	0,04
Elia Group SA/NV 1.50% 18 - 09.05.28	700 000	EUR	731 717	754 474	0,03
Elia Group SA/NV FRN 18 - 31.12.49	600 000	EUR	620 424	609 294	0,03
Elia Transmission Belgium SA 0.875% 20 - 28.04.30	600 000	EUR	607 619	612 828	0,03
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 15 - 27.05.24	400 000	EUR	418 729	417 176	0,02
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 19 - 14.01.26	800 000	EUR	833 729	842 856	0,04
Elia Transmission Belgium SA 3.00% 14 - 04.07.29	100 000	EUR	111 108	121 631	0,01
Elia Transmission Belgium SA 3.25% 13 - 04.04.28	200 000	EUR	244 114	243 012	0,01
Ethias SA 5.00% 15 - 14.01.26	400 000	EUR	433 548	430 600	0,02
Euroclear Bank SA 0.25% 18 - 09.07.22	620 000	EUR	622 901	622 920	0,03
Euroclear Bank SA 0.50% 18 - 07.10.23	700 000	EUR	709 682	709 177	0,03
KBC Group NV FRN 20 - 16.06.27	400 000	EUR	397 141	401 184	0,02
KBC Group NV FRN 19 - 12.03.29	1 100 000	EUR	1 078 477	1 062 875	0,05
KBC Group NV 0.625% 19 - 04.10.25	400 000	EUR	397 963	405 220	0,02
KBC Group NV 0.75% 16 - 18.10.23	1 300 000	EUR	1 317 914	1 317 654	0,06
KBC Group NV 0.75% 17 - 03.01.22	1 100 000	EUR	1 112 141	1 110 065	0,05
KBC Group NV 0.75% 20 - 24.01.30	400 000	EUR	394 141	401 688	0,02
KBC Group NV 0.875% 18 - 27.06.23	100 000	EUR	100 885	101 838	0,00
KBC Group NV 1.125% 19 - 25.01.24	700 000	EUR	709 114	718 732	0,03
KBC Group NV FRN 17 - 18.09.29	400 000	EUR	407 786	407 352	0,02
KBC Group NV FRN 15 - 03.11.27	200 000	EUR	207 716	201 612	0,01
KBC Group NV FRN 15 - 03.11.27	300 000	EUR	304 194	302 418	0,01
Lonza Finance International NV 1.625% 20 - 21.04.27	399 000	EUR	416 938	421 891	0,02
Lonza Finance International NV 1.625% 20 - 21.04.27	106 000	EUR	109 848	112 081	0,01
Solvay SA 0.50% 19 - 09.06.29	500 000	EUR	495 962	472 020	0,02
Solvay SA 1.625% 15 - 12.02.22	700 000	EUR	718 290	719 348	0,03
Solvay SA 2.75% 15 - 12.02.27	800 000	EUR	896 158	898 008	0,04
			45 621 428	46 118 922	2,06
Bermudes					
Bacardi Ltd. 2.75% 13 - 07.03.23	800 000	EUR	821 704	819 480	0,04
Fidelity International Ltd. 2.50% 16 - 11.04.26	500 000	EUR	545 048	508 845	0,02
			1 366 752	1 328 325	0,06
Brésil					
Vale SA 3.75% 12 - 01.10.23	630 000	EUR	678 047	650 469	0,03
			678 047	650 469	0,03
Îles Vierges britanniques					
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd. 1.00% 17 - 12.12.24	1 245 000	EUR	1 244 518	1 236 546	0,06
Global Switch Holdings Ltd. 1.50% 17 - 31.01.24	350 000	EUR	358 967	354 508	0,02
Global Switch Holdings Ltd. 2.25% 17 - 31.05.27	407 000	EUR	417 455	429 080	0,02
Huarong Universe Investment Holdings Ltd. 1.625% 17 - 12.05.22	307 000	EUR	296 870	291 834	0,01
Rail Transit International Development Co. Ltd. 1.625% 18 - 22.06.22	100 000	EUR	100 485	100 472	0,00
Talent Yield Euro Ltd. 1.30% 17 - 21.04.22	300 000	EUR	303 814	301 815	0,01
			2 722 109	2 714 255	0,12

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Canada					
Alimentation Couche-Tard Inc. 1.875% 16 - 05.06.26	674 000	EUR	712 295	707 262	0,03
Bank of Montreal 0.25% 18 - 17.11.21	1 020 000	EUR	1 022 637	1 022 407	0,05
Bank of Nova Scotia 0.125% 19 - 09.04.26	1 029 000	EUR	1 011 433	1 003 038	0,04
Bank of Nova Scotia 0.375% 17 - 04.06.22	200 000	EUR	201 342	200 596	0,01
Bank of Nova Scotia 0.50% 19 - 30.04.24	1 125 000	EUR	1 127 635	1 126 575	0,05
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.375% 19 - 05.03.24	1 100 000	EUR	1 097 666	1 094 126	0,05
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.375% 19 - 05.03.24	200 000	EUR	197 157	198 932	0,01
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.75% 18 - 22.03.23	1 074 000	EUR	1 094 636	1 094 664	0,05
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2.75% 18 - 29.03.28	800 000	EUR	829 090	828 216	0,04
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 0.25% 18 - 27.09.21	900 000	EUR	903 107	903 636	0,04
Great-West Lifeco Inc. 1.75% 16 - 12.07.26	492 000	EUR	525 640	518 022	0,02
Great-West Lifeco Inc. 2.50% 13 - 18.04.23	200 000	EUR	210 406	211 052	0,01
Magna International Inc. 1.50% 17 - 25.09.27	255 000	EUR	258 385	259 666	0,01
Magna International Inc. 1.90% 15 - 24.11.23	332 000	EUR	352 815	344 500	0,01
Magna International Inc. 1.90% 15 - 24.11.23	100 000	EUR	103 469	103 765	0,00
Royal Bank of Canada 0.125% 19 - 23.07.24	1 041 000	EUR	1 039 214	1 033 578	0,05
Royal Bank of Canada 0.25% 19 - 05.02.24	679 000	EUR	675 362	678 810	0,03
Toronto-Dominion Bank 0.375% 19 - 25.04.24	1 300 000	EUR	1 304 973	1 304 277	0,06
Toronto-Dominion Bank 0.625% 18 - 20.07.23	1 800 000	EUR	1 823 146	1 835 334	0,08
Total Capital Canada Ltd. 1.125% 14 - 18.03.22	1 000 000	EUR	1 019 385	1 017 920	0,05
Total Capital Canada Ltd. 2.125% 14 - 18.09.29	1 400 000	EUR	1 565 902	1 599 738	0,07
			17 075 695	17 086 114	0,76
Îles Caïmans					
CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd. 1.25% 18 - 13.04.25	600 000	EUR	611 603	605 544	0,03
CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd. 2.00% 18 - 13.04.30	400 000	EUR	436 831	426 068	0,02
CK Hutchison Finance 16 II Ltd. 0.875% 16 - 10.03.24	842 000	EUR	841 473	841 091	0,04
CK Hutchison Finance 16 Ltd. 1.25% 16 - 04.06.23	1 200 000	EUR	1 213 836	1 214 124	0,05
CK Hutchison Finance 16 Ltd. 2.00% 16 - 04.06.28	400 000	EUR	417 208	424 924	0,02
Hutchison Whampoa Europe Finance 12 Ltd. 3.625% 12 - 06.06.22	709 000	EUR	755 789	748 775	0,03
Hutchison Whampoa Finance 14 Ltd. 1.375% 14 - 31.10.21	914 000	EUR	927 120	924 255	0,04
XLIT Ltd. FRN 17 - 29.06.47	400 000	EUR	432 457	424 288	0,02
			5 636 317	5 609 069	0,25
Chine					
Bank of Communications Co. Ltd. FRN 14 - 10.03.26	450 000	EUR	459 040	454 684	0,02
China Merchants Bank Co. Ltd 0.25% 19 - 19.06.22	200 000	EUR	200 499	194 402	0,01
			659 539	649 086	0,03
République tchèque					
EP Infrastructure AS 1.659% 18 - 26.04.24	1 157 000	EUR	1 151 946	1 162 230	0,05
EP Infrastructure AS 1.698% 19 - 30.07.26	500 000	EUR	502 756	493 235	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
République tchèque (suite)					
EP Infrastructure AS 2.045% 19 - 10.09.28	450 000	EUR	445 997	436 558	0,02
NET4GAS sro 2.50% 14 - 28.07.21	180 000	EUR	184 041	183 650	0,01
			2 284 740	2 275 673	0,10
Danemark					
AP Moller - Maersk A/S 1.50% 15 - 24.11.22	554 000	EUR	569 231	564 061	0,03
AP Moller - Maersk A/S 1.75% 18 - 16.03.26	568 000	EUR	582 313	571 783	0,03
Carlsberg Breweries A/S 0.50% 17 - 09.06.23	392 000	EUR	396 979	395 081	0,02
Carlsberg Breweries A/S 0.625% 20 - 03.09.30	879 000	EUR	828 220	867 406	0,04
Carlsberg Breweries A/S 0.875% 19 - 07.01.29	500 000	EUR	509 197	509 810	0,02
Carlsberg Breweries A/S 2.50% 14 - 28.05.24	400 000	EUR	426 294	431 596	0,02
Carlsberg Breweries A/S 2.625% 12 - 15.11.22	310 000	EUR	328 618	327 648	0,01
Danfoss A/S 1.375% 14 - 23.02.22	425 000	EUR	432 427	430 555	0,02
Danica Pension Livsforsikrings AB FRN 15 - 29.09.45	300 000	EUR	333 048	322 020	0,01
Danske Bank A/S 0.25% 17 - 28.11.22	900 000	EUR	899 772	903 528	0,04
Danske Bank A/S FRN 19 - 27.08.25	1 100 000	EUR	1 085 832	1 077 340	0,05
Danske Bank A/S 0.625% 20 - 26.05.25	1 114 000	EUR	1 109 537	1 124 784	0,05
Danske Bank A/S 0.75% 16 - 06.02.23	1 114 000	EUR	1 124 939	1 133 941	0,05
Danske Bank A/S 0.875% 18 - 22.05.23	1 000 000	EUR	998 237	999 150	0,04
Danske Bank A/S 0.875% 18 - 22.05.23	200 000	EUR	203 202	199 830	0,01
Danske Bank A/S FRN 19 - 02.12.30	871 000	EUR	855 663	839 296	0,04
Danske Bank A/S FRN 20 - 24.05.23	1 218 000	EUR	1 231 851	1 229 534	0,06
Danske Bank A/S 1.625% 19 - 15.03.24	200 000	EUR	205 423	204 740	0,01
Danske Bank A/S FRN 19 - 21.06.29	500 000	EUR	503 332	510 390	0,02
DSV PANALPINA A/S 0.375% 20 - 26.02.27	607 000	EUR	579 007	576 547	0,03
ISS Global A/S 0.875% 19 - 18.06.26	500 000	EUR	499 573	484 805	0,02
ISS Global A/S 1.50% 17 - 31.08.27	450 000	EUR	442 421	446 098	0,02
ISS Global A/S 2.125% 14 - 12.02.24	407 000	EUR	436 497	423 003	0,02
Jyske Bank A/S FRN 19 - 20.06.24	680 000	EUR	666 901	671 976	0,03
Jyske Bank A/S 0.875% 18 - 12.03.21	903 000	EUR	906 293	907 976	0,04
Jyske Bank A/S FRN 17 - 04.05.29	244 000	EUR	246 263	246 799	0,01
Nykredit Realkredit A/S 0.125% 19 - 07.10.24	180 000	EUR	178 499	173 309	0,01
Nykredit Realkredit A/S 0.25% 19 - 20.01.23	560 000	EUR	557 060	552 143	0,02
Nykredit Realkredit A/S 0.50% 18 - 19.01.22	918 000	EUR	922 769	916 852	0,04
Nykredit Realkredit A/S 0.625% 19 - 17.01.25	200 000	EUR	200 988	195 530	0,01
Nykredit Realkredit A/S 0.75% 16 - 14.07.21	100 000	EUR	100 371	100 271	0,00
Nykredit Realkredit A/S 0.75% 20 - 20.01.27	1 160 000	EUR	1 136 437	1 125 281	0,05
Nykredit Realkredit A/S 0.875% 19 - 17.01.24	500 000	EUR	486 437	499 225	0,02
Nykredit Realkredit A/S FRN 15 - 17.11.27	650 000	EUR	677 013	669 201	0,03
Sydbank A/S 1.25% 19 - 02.04.22	600 000	EUR	606 069	598 662	0,03
			21 266 713	21 230 171	0,95
Estonie					
Luminor Bank AS Via Estonia 1.375% 19 - 21.10.22	400 000	EUR	399 690	393 872	0,02
Luminor Bank AS Via Estonia 1.50% 18 - 18.10.21	100 000	EUR	101 755	99 250	0,00
			501 445	493 122	0,02
Finlande					
CRH Finland Services OYJ 0.875% 20 - 11.05.23	405 000	EUR	405 949	411 290	0,02
Elenia Finance OYJ 0.375% 20 - 02.06.27	399 000	EUR	387 803	396 929	0,02
Elisa OYJ 0.875% 17 - 17.03.24	162 000	EUR	164 376	164 888	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Finlande (suite)					
Elisa OYJ 1.125% 19 - 26.02.26	300 000	EUR	305 724	308 904	0,01
Kojamo OYJ 1.50% 17 - 19.06.24	100 000	EUR	102 894	102 693	0,00
Kojamo OYJ 1.625% 18 - 03.07.25	500 000	EUR	515 557	514 940	0,02
Kojamo OYJ 1.875% 20 - 27.05.27	807 000	EUR	819 191	836 560	0,04
Metso OYJ 1.125% 17 - 13.06.24	352 000	EUR	359 353	347 435	0,02
Nordea Bank Abp 0.30% 17 - 30.06.22	1 000 000	EUR	1 003 678	1 007 300	0,05
Nordea Bank Abp 0.375% 19 - 28.05.26	700 000	EUR	702 504	713 559	0,03
Nordea Bank Abp 0.50% 20 - 14.05.27	1 118 000	EUR	1 120 999	1 142 674	0,05
Nordea Bank Abp 0.875% 18 - 26.06.23	790 000	EUR	802 529	801 487	0,04
Nordea Bank Abp 1.00% 16 - 22.02.23	1 475 000	EUR	1 511 354	1 515 740	0,07
Nordea Bank Abp FRN 16 - 09.07.26	1 400 000	EUR	1 386 981	1 395 324	0,06
Nordea Bank Abp FRN 19 - 27.06.29	200 000	EUR	202 319	194 076	0,01
Nordea Bank Abp 1.125% 15 - 02.12.25	1 100 000	EUR	1 141 565	1 158 278	0,05
Nordea Bank Abp 1.125% 17 - 27.09.27	785 000	EUR	824 872	838 930	0,04
Nordea Bank Abp 3.25% 12 - 07.05.22	300 000	EUR	319 201	319 839	0,01
OP Corporate Bank PLC 0.125% 20 - 07.01.24	500 000	EUR	499 800	498 780	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.375% 17 - 10.11.22	200 000	EUR	200 888	201 536	0,01
OP Corporate Bank PLC 0.375% 19 - 26.02.24	990 000	EUR	996 880	1 002 969	0,04
OP Corporate Bank PLC 0.375% 19 - 19.06.24	300 000	EUR	300 290	297 297	0,01
OP Corporate Bank PLC 0.50% 20 - 08.12.25	1 214 000	EUR	1 216 200	1 229 903	0,06
OP Corporate Bank PLC 0.60% 20 - 18.01.27	540 000	EUR	526 404	537 289	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.625% 19 - 11.12.29	450 000	EUR	433 056	441 558	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.75% 15 - 03.03.22	950 000	EUR	961 912	961 400	0,04
OP Corporate Bank PLC 1.00% 18 - 22.05.25	414 000	EUR	426 323	432 605	0,02
OP Corporate Bank PLC FRN 20 - 06.09.30	400 000	EUR	398 243	399 968	0,02
OP Corporate Bank PLC 5.75% 12 - 28.02.22	592 000	EUR	644 661	638 277	0,03
Sampo OYJ 1.00% 16 - 18.09.23	1 060 000	EUR	1 079 591	1 085 217	0,05
Sampo OYJ 1.25% 17 - 30.05.25	200 000	EUR	205 220	207 980	0,01
Sampo OYJ 1.625% 18 - 21.02.28	500 000	EUR	522 374	534 200	0,02
Sampo OYJ 2.25% 18 - 27.09.30	500 000	EUR	546 388	562 330	0,03
Sampo OYJ FRN 19 - 23.05.49	430 000	EUR	457 901	463 617	0,02
SATO OYJ 1.375% 19 - 31.05.24	300 000	EUR	297 560	292 923	0,01
SATO OYJ 2.25% 20 - 04.07.23	39 000	EUR	39 179	39 608	0,00
Stora Enso OYJ 2.125% 16 - 16.06.23	400 000	EUR	408 509	411 132	0,02
Stora Enso OYJ 2.50% 17 - 06.07.27	200 000	EUR	195 976	206 842	0,01
Stora Enso OYJ 2.50% 18 - 21.03.28	200 000	EUR	202 554	206 456	0,01
			22 636 758	22 822 733	1,02
France					
Accor SA 1.25% 17 - 25.01.24	500 000	EUR	508 732	478 535	0,02
Accor SA 1.75% 19 - 02.04.26	600 000	EUR	615 005	574 536	0,03
Accor SA 2.375% 15 - 17.09.23	700 000	EUR	716 892	701 344	0,03
Air Liquide Finance SA 0.375% 16 - 18.04.22	300 000	EUR	302 255	301 455	0,01
Air Liquide Finance SA 0.50% 16 - 13.06.22	400 000	EUR	400 760	403 348	0,02
Air Liquide Finance SA 0.625% 19 - 20.06.30	100 000	EUR	99 083	103 066	0,00
Air Liquide Finance SA 0.625% 19 - 20.06.30	400 000	EUR	398 083	412 264	0,02
Air Liquide Finance SA 0.75% 16 - 13.06.24	400 000	EUR	407 314	411 016	0,02
Air Liquide Finance SA 1.00% 17 - 03.08.27	500 000	EUR	515 492	529 775	0,02
Air Liquide Finance SA 1.00% 20 - 04.02.25	800 000	EUR	822 695	833 184	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Air Liquide Finance SA 1.00% 20 - 04.02.25	300 000	EUR	311 476	312 444	0,01
Air Liquide Finance SA 1.25% 15 - 06.03.25	200 000	EUR	212 082	210 790	0,01
Air Liquide Finance SA 1.25% 16 - 13.06.28	900 000	EUR	952 257	977 958	0,04
Air Liquide Finance SA 1.375% 20 - 04.02.30	500 000	EUR	530 518	546 680	0,02
Air Liquide Finance SA 1.875% 14 - 06.05.24	100 000	EUR	104 870	107 345	0,01
Air Liquide Finance SA 2.125% 12 - 15.10.21	300 000	EUR	308 392	308 148	0,01
Air Liquide SA 2.375% 13 - 09.06.23	300 000	EUR	325 391	322 602	0,01
ALD SA 0.375% 19 - 18.07.23	500 000	EUR	478 664	484 840	0,02
ALD SA 0.875% 17 - 18.07.22	100 000	EUR	96 059	98 242	0,00
ALD SA 1.25% 18 - 10.11.22	600 000	EUR	607 102	594 684	0,03
Alstom SA 0.25% 19 - 14.10.26	600 000	EUR	596 122	573 534	0,03
Altarea SCA 1.875% 19 - 17.01.28	500 000	EUR	483 761	461 205	0,02
Altarea SCA 2.25% 17 - 07.05.24	700 000	EUR	721 584	713 797	0,03
Altareit SCA 2.875% 18 - 07.02.25	100 000	EUR	97 101	101 579	0,00
APRR SA Zero Coupon 20 - 20.01.23	400 000	EUR	401 715	397 660	0,02
APRR SA 1.125% 16 - 01.09.26	300 000	EUR	309 964	312 579	0,01
APRR SA 1.25% 16 - 01.06.27	100 000	EUR	103 140	105 610	0,01
APRR SA 1.25% 19 - 18.01.28	500 000	EUR	513 939	528 250	0,02
APRR SA 1.25% 20 - 14.01.27	600 000	EUR	617 446	629 280	0,03
APRR SA 1.50% 15 - 15.01.24	100 000	EUR	101 967	103 859	0,00
APRR SA 1.50% 15 - 15.01.24	700 000	EUR	737 181	727 013	0,03
APRR SA 1.50% 17 - 17.01.33	700 000	EUR	760 370	763 658	0,03
APRR SA 1.50% 18 - 25.01.30	600 000	EUR	631 649	649 644	0,03
APRR SA 1.625% 17 - 13.01.32	600 000	EUR	632 067	656 298	0,03
APRR SA 1.875% 14 - 15.01.25	600 000	EUR	640 195	640 374	0,03
APRR SA 1.875% 16 - 01.06.31	400 000	EUR	455 955	444 132	0,02
Arkema SA 0.75% 19 - 12.03.29	300 000	EUR	299 562	290 790	0,01
Arkema SA 1.50% 15 - 20.01.25	300 000	EUR	319 858	313 539	0,01
Arkema SA 1.50% 17 - 20.04.27	1 100 000	EUR	1 129 479	1 149 775	0,05
Arkema SA FRN 20 - 31.12.99	500 000	EUR	455 657	470 675	0,02
Arkema SA FRN 19 - 31.12.99	300 000	EUR	302 503	300 063	0,01
Atos SE 0.75% 18 - 05.07.22	800 000	EUR	806 061	807 304	0,04
Atos SE 1.75% 18 - 05.07.25	300 000	EUR	301 241	317 706	0,01
Atos SE 1.75% 18 - 05.07.25	500 000	EUR	525 981	529 510	0,02
Atos SE 2.50% 18 - 11.07.28	300 000	EUR	341 378	343 551	0,02
Auchan Holding SA 0.625% 17 - 02.07.22	800 000	EUR	798 636	787 656	0,04
Auchan Holding SA 2.25% 13 - 04.06.23	700 000	EUR	726 389	708 302	0,03
Auchan Holding SA 2.375% 12 - 12.12.22	600 000	EUR	621 131	611 970	0,03
Auchan Holding SA 2.375% 19 - 25.04.25	1 200 000	EUR	1 211 743	1 190 880	0,05
Auchan Holding SA 2.625% 19 - 30.01.24	1 100 000	EUR	1 145 251	1 121 472	0,05
Auchan Holding SA 2.875% 20 - 29.01.26	1 000 000	EUR	1 014 438	999 350	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 1.00% 16 - 13.05.26	200 000	EUR	207 735	209 404	0,01
Autoroutes du Sud de la France SA 1.125% 17 - 20.04.26	200 000	EUR	199 627	210 552	0,01
Autoroutes du Sud de la France SA 1.125% 17 - 20.04.26	600 000	EUR	627 059	631 656	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Autoroutes du Sud de la France SA 1.25% 17 - 18.01.27	300 000	EUR	300 493	319 221	0,01
Autoroutes du Sud de la France SA 1.25% 17 - 18.01.27	1 000 000	EUR	1 037 030	1 064 070	0,05
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 22.01.30	900 000	EUR	962 786	978 192	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 27.06.28	500 000	EUR	521 264	540 445	0,02
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 19 - 21.02.31	1 300 000	EUR	1 379 286	1 414 907	0,06
Autoroutes du Sud de la France SA 2.875% 13 - 18.01.23	1 100 000	EUR	1 180 326	1 175 845	0,05
Autoroutes du Sud de la France SA 2.95% 14 - 17.01.24	500 000	EUR	544 419	545 585	0,02
Autoroutes du Sud de la France SA 5.625% 07 - 07.04.22	1 300 000	EUR	1 448 170	1 439 451	0,06
AXA SA 1.125% 16 - 15.05.28	400 000	EUR	427 886	432 428	0,02
AXA SA FRN 18 - 28.05.49	1 900 000	EUR	2 044 249	2 081 412	0,09
AXA SA FRN 16 - 07.06.47	1 453 000	EUR	1 589 402	1 591 747	0,07
AXA SA FRN 14 - 20.05.49	700 000	EUR	753 625	762 790	0,03
AXA SA FRN 14 - 29.11.49	800 000	EUR	878 960	865 080	0,04
AXA SA FRN 14 - 29.11.49	500 000	EUR	540 750	540 675	0,02
AXA SA FRN 13 - 07.04.43	1 300 000	EUR	1 476 027	1 447 953	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 18 - 30.08.21	1 000 000	EUR	1 001 592	1 000 950	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 19 - 02.05.24	1 800 000	EUR	1 801 419	1 795 446	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.375% 17 - 13.01.22	1 100 000	EUR	1 104 633	1 104 312	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.50% 18 - 16.11.22	1 600 000	EUR	1 613 671	1 614 464	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 18 - 17.07.25	1 300 000	EUR	1 307 151	1 335 542	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 20 - 17.01.30	1 200 000	EUR	1 200 437	1 188 276	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 15 - 14.01.25	900 000	EUR	939 130	942 831	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 17 - 26.05.27	1 000 000	EUR	1 028 589	1 069 260	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 20 - 06.03.30	1 200 000	EUR	1 212 243	1 235 124	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.375% 18 - 16.07.28	1 000 000	EUR	1 067 494	1 084 950	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 16 - 19.01.26	1 100 000	EUR	1 167 114	1 185 184	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 17 - 15.11.27	600 000	EUR	606 527	606 948	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.375% 16 - 24.03.26	800 000	EUR	821 729	841 456	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.50% 18 - 25.05.28	200 000	EUR	200 024	215 260	0,01
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 14 - 18.03.24	1 100 000	EUR	1 189 231	1 200 276	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 17 - 31.03.27	400 000	EUR	426 799	429 308	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 13 - 28.11.23	1 500 000	EUR	1 633 574	1 646 910	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 14 - 21.05.24	900 000	EUR	957 839	963 684	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 15 - 09.11.25	1 000 000	EUR	1 078 769	1 090 710	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.25% 12 - 23.08.22	1 000 000	EUR	1 075 355	1 067 470	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 19 - 15.06.23	1 600 000	EUR	1 617 577	1 630 160	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 19 - 06.08.26	1 200 000	EUR	1 219 610	1 228 812	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19 - 15.03.29	900 000	EUR	955 683	978 192	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 16 - 11.04.26	700 000	EUR	719 052	718 179	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 19 - 18.06.29	800 000	EUR	835 000	823 616	0,04
BNP Paribas Cardif SA 1.00% 17 - 29.11.24	500 000	EUR	475 525	495 715	0,02
BNP Paribas Cardif SA FRN 14 - 29.11.49	900 000	EUR	965 367	966 159	0,04
BNP Paribas SA 0.125% 19 - 09.04.26	1 100 000	EUR	1 074 803	1 056 154	0,05
BNP Paribas SA 0.50% 16 - 06.01.22	900 000	EUR	906 420	909 009	0,04
BNP Paribas SA FRN 19 - 15.07.25	1 000 000	EUR	1 003 854	990 370	0,04
BNP Paribas SA FRN 19 - 06.04.26	700 000	EUR	702 573	691 005	0,03
BNP Paribas SA FRN 20 - 19.02.28	1 300 000	EUR	1 274 556	1 264 601	0,06
BNP Paribas SA 0.75% 16 - 11.11.22	1 050 000	EUR	1 064 409	1 066 999	0,05
BNP Paribas SA 1.00% 17 - 27.06.24	770 000	EUR	780 373	782 666	0,04
BNP Paribas SA 1.00% 18 - 17.04.24	200 000	EUR	205 865	203 272	0,01
BNP Paribas SA 1.125% 16 - 15.01.23	1 177 000	EUR	1 206 687	1 209 179	0,05
BNP Paribas SA 1.125% 17 - 10.10.23	1 100 000	EUR	1 105 894	1 121 109	0,05
BNP Paribas SA 1.125% 18 - 06.11.26	1 000 000	EUR	993 676	1 018 350	0,05
BNP Paribas SA 1.125% 18 - 22.11.23	1 170 000	EUR	1 196 704	1 193 728	0,05
BNP Paribas SA 1.125% 19 - 28.08.24	900 000	EUR	920 441	919 332	0,04
BNP Paribas SA FRN 20 - 15.01.32	1 100 000	EUR	1 096 182	1 060 312	0,05
BNP Paribas SA FRN 20 - 17.04.29	1 000 000	EUR	1 001 044	1 009 520	0,05
BNP Paribas SA 1.25% 18 - 19.03.25	644 000	EUR	657 603	661 942	0,03
BNP Paribas SA 1.375% 19 - 28.05.29	1 300 000	EUR	1 315 064	1 356 134	0,06
BNP Paribas SA 1.50% 16 - 25.05.28	1 185 000	EUR	1 292 500	1 317 696	0,06
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 17.11.25	900 000	EUR	921 709	939 321	0,04
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 23.05.28	700 000	EUR	725 707	736 127	0,03
BNP Paribas SA 1.625% 16 - 23.02.26	785 000	EUR	841 263	859 960	0,04
BNP Paribas SA 1.625% 19 - 07.02.31	900 000	EUR	905 329	891 369	0,04
BNP Paribas SA FRN 19 - 23.01.27	1 800 000	EUR	1 912 895	1 924 434	0,09
BNP Paribas SA 2.25% 16 - 01.11.27	950 000	EUR	1 010 095	1 009 413	0,05
BNP Paribas SA 2.375% 14 - 20.05.24	768 000	EUR	817 594	838 479	0,04
BNP Paribas SA 2.375% 15 - 17.02.25	1 390 000	EUR	1 471 381	1 469 244	0,07
BNP Paribas SA FRN 18 - 20.11.30	700 000	EUR	737 737	741 083	0,03
BNP Paribas SA FRN 14 - 14.10.27	600 000	EUR	610 218	612 372	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
BNP Paribas SA 2.75% 15 - 27.01.26	900 000	EUR	949 041	973 296	0,04
BNP Paribas SA 2.875% 12 - 24.10.22	1 100 000	EUR	1 162 745	1 171 357	0,05
BNP Paribas SA 2.875% 13 - 26.09.23	1 302 000	EUR	1 409 293	1 422 253	0,06
BNP Paribas SA 2.875% 16 - 10.01.26	920 000	EUR	999 534	1 010 482	0,05
BNP Paribas SA 4.125% 11 - 14.01.22	1 265 000	EUR	1 348 174	1 343 632	0,06
BNP Paribas SA 4.50% 11 - 21.03.23	900 000	EUR	1 011 720	1 009 233	0,05
Bouygues SA 1.125% 20 - 24.07.28	800 000	EUR	830 364	831 472	0,04
Bouygues SA 1.375% 16 - 06.07.27	600 000	EUR	635 209	640 878	0,03
Bouygues SA 3.625% 12 - 16.01.23	1 000 000	EUR	1 095 299	1 088 400	0,05
Bouygues SA 4.50% 12 - 02.09.22	600 000	EUR	641 232	641 946	0,03
BPCE SA 0.125% 19 - 12.04.24	800 000	EUR	799 374	796 872	0,04
BPCE SA 0.25% 20 - 15.01.26	1 100 000	EUR	1 096 589	1 092 674	0,05
BPCE SA 0.375% 16 - 10.05.23	400 000	EUR	398 525	403 004	0,02
BPCE SA 0.50% 19 - 24.02.27	1 300 000	EUR	1 290 311	1 276 678	0,06
BPCE SA 0.625% 18 - 26.09.23	1 200 000	EUR	1 209 659	1 218 060	0,05
BPCE SA 0.625% 19 - 26.09.24	800 000	EUR	805 141	799 784	0,04
BPCE SA 0.625% 19 - 26.09.24	300 000	EUR	299 010	299 919	0,01
BPCE SA 0.625% 20 - 15.01.30	800 000	EUR	783 761	810 648	0,04
BPCE SA 0.625% 20 - 28.04.25	1 400 000	EUR	1 408 189	1 420 860	0,06
BPCE SA 0.875% 18 - 31.01.24	900 000	EUR	898 834	908 505	0,04
BPCE SA 1.00% 16 - 10.05.28	700 000	EUR	716 138	740 537	0,03
BPCE SA 1.00% 19 - 15.07.24	1 300 000	EUR	1 336 062	1 341 015	0,06
BPCE SA 1.00% 19 - 04.01.25	1 200 000	EUR	1 221 942	1 216 032	0,05
BPCE SA 1.125% 17 - 18.01.23	1 100 000	EUR	1 107 788	1 114 597	0,05
BPCE SA 1.375% 18 - 23.03.26	600 000	EUR	599 525	620 484	0,03
BPCE SA 1.625% 18 - 31.01.28	900 000	EUR	957 349	953 325	0,04
BPCE SA FRN 14 - 07.08.26	400 000	EUR	403 125	406 752	0,02
BPCE SA FRN 15 - 30.11.27	800 000	EUR	815 488	831 416	0,04
BPCE SA 2.875% 13 - 16.01.24	500 000	EUR	549 607	545 850	0,02
BPCE SA 2.875% 16 - 22.04.26	500 000	EUR	547 051	549 320	0,02
BPCE SA 3.00% 14 - 19.07.24	900 000	EUR	999 148	1 000 944	0,04
BPCE SA 4.25% 12 - 02.06.23	700 000	EUR	768 229	773 143	0,03
BPCE SA 4.50% 12 - 02.10.22	1 300 000	EUR	1 399 122	1 392 729	0,06
BPCE SA 4.625% 13 - 18.07.23	1 000 000	EUR	1 101 386	1 110 150	0,05
Caisse Federale du Credit Mutuel Nord Europe					
SCOFAV 2.125% 16 - 09.12.26	200 000	EUR	206 388	192 616	0,01
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole					
Groupama 2.125% 19 - 16.09.29	400 000	EUR	373 966	382 056	0,02
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole					
Groupama 3.375% 18 - 24.09.28	400 000	EUR	418 407	421 216	0,02
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole					
Groupama 6.00% 17 - 23.01.27	700 000	EUR	859 022	840 868	0,04
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole					
Groupama FRN 14 - 29.05.49	1 000 000	EUR	1 130 266	1 101 550	0,05
Capgemini SE 0.50% 16 - 11.09.21	400 000	EUR	400 524	400 896	0,02
Capgemini SE 0.625% 20 - 23.06.25	100 000	EUR	99 888	100 042	0,00
Capgemini SE 1.00% 18 - 18.10.24	200 000	EUR	202 006	203 882	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Capgemini SE 1.125% 20 - 23.06.30	100 000	EUR	99 522	99 243	0,00
Capgemini SE 1.25% 20 - 15.04.22	400 000	EUR	404 183	405 136	0,02
Capgemini SE 1.625% 20 - 15.04.26	600 000	EUR	620 139	629 736	0,03
Capgemini SE 1.75% 18 - 18.04.28	600 000	EUR	654 598	638 346	0,03
Capgemini SE 2.00% 20 - 15.04.29	800 000	EUR	843 028	860 048	0,04
Capgemini SE 2.00% 20 - 15.04.29	100 000	EUR	105 418	107 506	0,01
Capgemini SE 2.375% 20 - 15.04.32	1 300 000	EUR	1 409 369	1 428 908	0,06
Capgemini SE 2.50% 15 - 07.01.23	200 000	EUR	213 899	211 756	0,01
Capgemini SE 2.50% 15 - 07.01.23	800 000	EUR	841 722	847 024	0,04
Carmila SA 2.125% 18 - 03.07.28	300 000	EUR	289 042	291 537	0,01
Carmila SA 2.375% 15 - 18.09.23	800 000	EUR	833 206	819 696	0,04
Carmila SA 2.375% 16 - 16.09.24	400 000	EUR	426 151	402 980	0,02
Carrefour SA 0.75% 16 - 26.04.24	800 000	EUR	794 727	814 088	0,04
Carrefour SA 0.875% 18 - 06.12.23	600 000	EUR	606 627	610 302	0,03
Carrefour SA 1.00% 19 - 17.05.27	500 000	EUR	508 135	512 855	0,02
Carrefour SA 1.25% 15 - 06.03.25	188 000	EUR	195 006	196 652	0,01
Carrefour SA 1.75% 14 - 15.07.22	1 100 000	EUR	1 134 667	1 127 764	0,05
Carrefour SA 1.75% 18 - 05.04.26	600 000	EUR	597 842	641 052	0,03
Carrefour SA 2.625% 20 - 15.12.27	1 000 000	EUR	1 052 051	1 119 250	0,05
Ceetrus SA 2.75% 19 - 26.11.26	200 000	EUR	198 338	194 430	0,01
Cie de Saint-Gobain 0.625% 19 - 15.03.24	900 000	EUR	907 457	908 991	0,04
Cie de Saint-Gobain 0.875% 18 - 21.09.23	600 000	EUR	607 821	610 392	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.00% 17 - 17.03.25	700 000	EUR	698 868	719 012	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.125% 18 - 23.03.26	700 000	EUR	705 510	724 948	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.375% 17 - 14.06.27	700 000	EUR	735 927	732 571	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.75% 20 - 04.03.23	600 000	EUR	600 276	622 170	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.875% 18 - 21.09.28	700 000	EUR	746 156	754 355	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.875% 19 - 15.03.31	1 000 000	EUR	1 070 368	1 078 360	0,05
Cie de Saint-Gobain 2.375% 20 - 10.04.27	600 000	EUR	596 186	662 748	0,03
Cie de Saint-Gobain 3.625% 12 - 28.03.22	600 000	EUR	637 013	636 078	0,03
Cie de Saint-Gobain 3.625% 12 - 15.06.21	100 000	EUR	103 286	103 399	0,00
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 0.375% 16 - 02.07.25	500 000	EUR	502 342	504 770	0,02
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 0.75% 16 - 09.09.28	500 000	EUR	518 065	515 750	0,02
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.00% 20 - 19.05.31	1 200 000	EUR	1 210 231	1 251 084	0,06
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.125% 17 - 13.10.27	500 000	EUR	502 652	528 765	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.875% 18 - 09.03.25	600 000	EUR	602 644	619 710	0,03
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 18 - 09.03.30	400 000	EUR	411 527	452 004	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 18 - 09.03.30	400 000	EUR	447 425	452 004	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 2.50% 18 - 09.03.38	700 000	EUR	817 106	893 494	0,04
CNP Assurances 1.875% 16 - 20.10.22	900 000	EUR	916 403	918 414	0,04
CNP Assurances FRN 19 - 27.07.50	700 000	EUR	688 423	675 997	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
CNP Assurances FRN 20 - 30.06.51	400 000	EUR	398 368	398 012	0,02
CNP Assurances 2.75% 19 - 02.05.29	500 000	EUR	539 213	547 915	0,02
CNP Assurances FRN 14 - 29.11.49	100 000	EUR	108 436	106 723	0,01
CNP Assurances FRN 14 - 06.05.45	800 000	EUR	880 904	890 096	0,04
CNP Assurances FRN 15 - 06.10.47	600 000	EUR	713 958	689 280	0,03
CNP Assurances FRN 11 - 30.09.41	1 100 000	EUR	1 194 758	1 174 492	0,05
Coface SA 4.125% 14 - 27.03.24	300 000	EUR	328 509	324 807	0,01
Covivio 1.125% 19 - 17.09.31	300 000	EUR	306 692	282 783	0,01
Covivio 1.125% 19 - 17.09.31	200 000	EUR	186 011	188 522	0,01
Covivio 1.50% 17 - 21.06.27	600 000	EUR	591 575	604 464	0,03
Covivio 1.625% 17 - 17.10.24	150 000	EUR	148 325	152 588	0,01
Covivio 1.875% 16 - 20.05.26	400 000	EUR	435 229	411 952	0,02
Covivio 2.375% 18 - 20.02.28	200 000	EUR	202 300	212 308	0,01
Covivio Hotels SACA 1.875% 18 - 24.09.25	200 000	EUR	194 254	185 268	0,01
Credit Agricole Assurances SA FRN 18 - 29.01.48	1 000 000	EUR	997 075	1 010 300	0,05
Credit Agricole Assurances SA FRN 15 - 31.12.49	600 000	EUR	650 893	644 256	0,03
Credit Agricole Assurances SA FRN 15 - 31.12.49	300 000	EUR	329 523	322 128	0,01
Credit Agricole Assurances SA FRN 14 - 31.10.49	800 000	EUR	903 386	876 288	0,04
Credit Agricole Assurances SA FRN 16 - 27.09.48	700 000	EUR	802 085	819 952	0,04
Credit Agricole SA 0.375% 19 - 21.10.25	600 000	EUR	599 316	591 450	0,03
Credit Agricole SA 0.50% 19 - 24.06.24	1 300 000	EUR	1 301 116	1 297 205	0,06
Credit Agricole SA 0.75% 16 - 12.01.22	900 000	EUR	911 796	917 793	0,04
Credit Agricole SA 0.75% 18 - 12.05.23	1 100 000	EUR	1 113 982	1 125 938	0,05
Credit Agricole SA 0.875% 15 - 19.01.22	1 200 000	EUR	1 216 960	1 217 676	0,05
Credit Agricole SA 0.875% 20 - 14.01.32	1 100 000	EUR	1 061 493	1 083 324	0,05
Credit Agricole SA 1.00% 17 - 16.09.24	200 000	EUR	207 961	208 170	0,01
Credit Agricole SA 1.00% 19 - 07.03.29	900 000	EUR	932 443	959 850	0,04
Credit Agricole SA FRN 20 - 22.04.26	1 800 000	EUR	1 805 188	1 816 686	0,08
Credit Agricole SA 1.25% 16 - 14.04.26	1 200 000	EUR	1 230 412	1 277 832	0,06
Credit Agricole SA 1.375% 17 - 05.03.27	1 700 000	EUR	1 769 968	1 836 714	0,08
Credit Agricole SA 1.375% 18 - 13.03.25	1 400 000	EUR	1 449 510	1 451 030	0,07
Credit Agricole SA FRN 20 - 06.05.30	900 000	EUR	902 796	904 356	0,04
Credit Agricole SA 1.75% 19 - 03.05.29	1 300 000	EUR	1 378 175	1 397 734	0,06
Credit Agricole SA 1.875% 16 - 20.12.26	1 400 000	EUR	1 486 167	1 503 320	0,07
Credit Agricole SA 2.00% 19 - 25.03.29	1 200 000	EUR	1 223 856	1 244 076	0,06
Credit Agricole SA 2.375% 14 - 20.05.24	1 400 000	EUR	1 512 202	1 525 678	0,07
Credit Agricole SA 2.625% 15 - 17.03.27	1 844 000	EUR	1 979 972	1 987 519	0,09
Credit Agricole SA 3.125% 13 - 17.07.23	1 000 000	EUR	1 098 352	1 096 440	0,05
Credit Agricole SA 3.125% 14 - 02.05.26	900 000	EUR	1 051 227	1 051 299	0,05
Credit Agricole SA 5.125% 11 - 18.04.23	900 000	EUR	1 032 179	1 031 904	0,05
Credit Logement SA FRN 17 - 28.11.29	400 000	EUR	394 999	400 956	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.375% 19 - 10.03.28	300 000	EUR	298 051	294 543	0,01
Credit Mutuel Arkea SA 0.375% 19 - 10.03.28	200 000	EUR	195 967	196 362	0,01
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 18 - 10.05.23	100 000	EUR	100 018	101 763	0,00
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 20 - 05.07.27	1 300 000	EUR	1 311 722	1 323 595	0,06
Credit Mutuel Arkea SA 1.00% 15 - 26.01.23	300 000	EUR	308 697	305 850	0,01
Credit Mutuel Arkea SA 1.125% 19 - 23.05.29	400 000	EUR	408 968	413 464	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 1.25% 17 - 31.05.24	300 000	EUR	310 338	306 051	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Credit Mutuel Arkea SA FRN 20 - 06.11.29	100 000	EUR	99 109	100 337	0,00
Credit Mutuel Arkea SA 1.375% 19 - 17.01.25	300 000	EUR	310 868	313 596	0,01
Credit Mutuel Arkea SA 1.625% 19 - 15.04.26	300 000	EUR	308 261	312 621	0,01
Credit Mutuel Arkea SA FRN 17 - 25.10.29	200 000	EUR	184 193	200 002	0,01
Credit Mutuel Arkea SA 3.25% 16 - 06.01.26	700 000	EUR	765 643	776 846	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 19 - 03.11.31	700 000	EUR	797 251	781 025	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 3.50% 17 - 02.09.29	400 000	EUR	446 941	453 312	0,02
Danone SA 0.395% 20 - 06.10.29	400 000	EUR	400 000	403 980	0,02
Danone SA 0.424% 16 - 11.03.22	800 000	EUR	806 244	806 392	0,04
Danone SA 0.571% 20 - 17.03.27	1 000 000	EUR	1 002 414	1 025 620	0,05
Danone SA 0.709% 16 - 11.03.24	1 600 000	EUR	1 639 398	1 646 544	0,07
Danone SA 1.00% 18 - 26.03.25	600 000	EUR	619 357	627 384	0,03
Danone SA 1.125% 15 - 14.01.25	400 000	EUR	417 646	419 676	0,02
Danone SA 1.208% 16 - 11.03.28	1 100 000	EUR	1 167 563	1 193 027	0,05
Danone SA 1.25% 15 - 30.05.24	700 000	EUR	727 456	732 487	0,03
Danone SA FRN 17 - 31.12.99	1 200 000	EUR	1 203 642	1 191 480	0,05
Danone SA 2.25% 13 - 15.11.21	800 000	EUR	821 765	820 072	0,04
Danone SA 2.60% 13 - 28.06.23	200 000	EUR	210 466	215 534	0,01
Dassault Systemes SE Zero Coupon 19 - 16.09.22	600 000	EUR	602 165	598 776	0,03
Dassault Systemes SE Zero Coupon 19 - 16.09.24	500 000	EUR	492 612	497 265	0,02
Dassault Systemes SE 0.125% 19 - 16.09.26	500 000	EUR	499 806	495 145	0,02
Dassault Systemes SE 0.125% 19 - 16.09.26	300 000	EUR	298 439	297 087	0,01
Dassault Systemes SE 0.375% 19 - 16.09.29	1 100 000	EUR	1 098 314	1 092 927	0,05
Edenred 1.375% 15 - 03.10.25	500 000	EUR	518 683	511 625	0,02
Edenred 1.875% 17 - 30.03.27	100 000	EUR	105 181	106 208	0,01
Edenred 1.875% 18 - 03.06.26	800 000	EUR	819 969	844 976	0,04
Engie Alliance GIE 5.75% 03 - 24.06.23	636 000	EUR	742 134	743 459	0,03
Engie SA Zero Coupon 19 - 03.04.27	700 000	EUR	688 269	683 032	0,03
Engie SA 0.375% 17 - 28.02.23	600 000	EUR	604 535	603 948	0,03
Engie SA 0.375% 19 - 21.06.27	800 000	EUR	810 082	796 240	0,04
Engie SA 0.375% 20 - 06.11.27	200 000	EUR	198 516	199 864	0,01
Engie SA 0.50% 15 - 13.03.22	700 000	EUR	702 917	703 668	0,03
Engie SA 0.50% 19 - 24.10.30	800 000	EUR	795 150	780 632	0,04
Engie SA 0.875% 17 - 27.03.24	900 000	EUR	916 275	924 444	0,04
Engie SA 0.875% 18 - 19.09.25	400 000	EUR	408 550	412 324	0,02
Engie SA 1.00% 15 - 13.03.26	1 100 000	EUR	1 134 695	1 143 725	0,05
Engie SA 1.25% 19 - 24.10.41	600 000	EUR	596 241	590 214	0,03
Engie SA 1.375% 17 - 28.02.29	600 000	EUR	618 662	636 132	0,03
Engie SA FRN 18 - 31.12.99	1 400 000	EUR	1 373 522	1 361 500	0,06
Engie SA 1.375% 18 - 22.06.28	700 000	EUR	725 553	738 262	0,03
Engie SA 1.375% 19 - 21.06.39	600 000	EUR	621 651	609 252	0,03
Engie SA 1.375% 19 - 21.06.39	100 000	EUR	101 004	101 542	0,00
Engie SA 1.375% 20 - 27.03.25	900 000	EUR	917 039	946 710	0,04
Engie SA 1.50% 15 - 13.03.35	300 000	EUR	321 220	316 803	0,01
Engie SA 1.50% 17 - 27.03.28	700 000	EUR	739 666	754 803	0,03
Engie SA FRN 19 - 31.12.99	200 000	EUR	200 287	194 912	0,01
Engie SA FRN 19 - 31.12.99	300 000	EUR	300 612	292 368	0,01
Engie SA 1.75% 20 - 27.03.28	800 000	EUR	836 597	865 912	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Engie SA 1.875% 18 - 19.09.33	600 000	EUR	653 653	676 386	0,03
Engie SA 2.00% 17 - 28.09.37	700 000	EUR	779 338	777 322	0,04
Engie SA 2.125% 20 - 30.03.32	400 000	EUR	426 320	458 728	0,02
Engie SA 2.125% 20 - 30.03.32	400 000	EUR	453 145	458 728	0,02
Engie SA 2.375% 14 - 19.05.26	1 200 000	EUR	1 334 191	1 346 652	0,06
Engie SA 2.625% 12 - 20.07.22	300 000	EUR	317 353	315 126	0,01
Engie SA 3.00% 12 - 02.01.23	750 000	EUR	806 755	805 755	0,04
Engie SA FRN 19 - 31.12.99	900 000	EUR	937 335	943 020	0,04
Engie SA 3.50% 10 - 18.10.22	300 000	EUR	323 956	322 416	0,01
Engie SA FRN 14 - 06.02.49	1 000 000	EUR	1 106 201	1 065 260	0,05
Engie SA FRN 13 - 29.07.49	200 000	EUR	213 410	205 994	0,01
Engie SA 5.95% 11 - 16.03.11	246 000	EUR	462 885	507 336	0,02
EssilorLuxottica SA Zero Coupon 19 - 27.05.23	800 000	EUR	801 695	797 520	0,04
EssilorLuxottica SA 0.125% 19 - 27.05.25	1 700 000	EUR	1 694 027	1 690 582	0,08
EssilorLuxottica SA 0.25% 20 - 01.05.24	400 000	EUR	400 420	401 628	0,02
EssilorLuxottica SA 0.375% 19 - 27.11.27	1 500 000	EUR	1 498 772	1 495 185	0,07
EssilorLuxottica SA 0.375% 20 - 01.05.26	1 200 000	EUR	1 198 152	1 200 372	0,05
EssilorLuxottica SA 0.50% 20 - 06.05.28	1 300 000	EUR	1 294 371	1 296 295	0,06
EssilorLuxottica SA 0.75% 19 - 27.11.31	700 000	EUR	705 718	706 643	0,03
EssilorLuxottica SA 2.375% 14 - 04.09.24	200 000	EUR	218 048	215 990	0,01
EssilorLuxottica SA 2.625% 14 - 02.10.24	192 000	EUR	211 031	208 691	0,01
Eutelsat SA 2.00% 18 - 10.02.25	700 000	EUR	709 580	713 804	0,03
Eutelsat SA 2.25% 19 - 13.07.27	400 000	EUR	418 651	405 400	0,02
Eutelsat SA 2.25% 19 - 13.07.27	200 000	EUR	191 967	202 700	0,01
Eutelsat SA 3.125% 12 - 10.10.22	100 000	EUR	106 802	104 658	0,00
Firmenich Productions Participations SAS 1.375% 20 - 30.10.26	1 122 000	EUR	1 140 851	1 153 102	0,05
Firmenich Productions Participations SAS 1.75% 20 - 30.04.30	598 000	EUR	610 468	622 147	0,03
Gecina SA 1.00% 16 - 30.01.29	500 000	EUR	508 098	504 645	0,02
Gecina SA 1.375% 17 - 30.06.27	800 000	EUR	843 515	836 224	0,04
Gecina SA 1.375% 17 - 26.01.28	400 000	EUR	405 768	416 860	0,02
Gecina SA 1.50% 15 - 20.01.25	400 000	EUR	422 342	415 372	0,02
Gecina SA 1.625% 18 - 14.03.30	500 000	EUR	508 643	528 850	0,02
Gecina SA 1.625% 19 - 29.05.34	500 000	EUR	527 137	516 295	0,02
Gecina SA 2.00% 15 - 17.06.24	100 000	EUR	108 130	105 402	0,01
Gecina SA 2.00% 17 - 30.06.32	400 000	EUR	392 469	431 360	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SAS 0.625% 17 - 27.03.23	500 000	EUR	504 215	485 145	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SAS 1.625% 17 - 27.11.27	700 000	EUR	683 749	678 244	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SAS 2.25% 14 - 24.03.25	300 000	EUR	312 581	304 296	0,01
Holding d'Infrastructures de Transport SAS 4.875% 06 - 27.10.21	800 000	EUR	846 197	841 728	0,04
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 2.50% 20 - 05.04.27	500 000	EUR	498 034	514 160	0,02
HSBC France SA 0.10% 19 - 09.03.27	1 200 000	EUR	1 189 554	1 162 716	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
HSBC France SA 0.20% 18 - 09.04.21	1 700 000	EUR	1 705 142	1 704 250	0,08
HSBC France SA 0.25% 19 - 17.05.24	1 200 000	EUR	1 205 330	1 202 472	0,05
HSBC France SA 0.60% 18 - 20.03.23	300 000	EUR	303 347	304 239	0,01
HSBC France SA 0.60% 18 - 20.03.23	800 000	EUR	810 159	811 304	0,04
HSBC France SA 1.375% 18 - 09.04.28	600 000	EUR	641 221	652 488	0,03
Icade 1.75% 16 - 06.10.26	500 000	EUR	529 470	507 540	0,02
ICADE 1.125% 16 - 17.11.25	500 000	EUR	505 385	493 445	0,02
ICADE 1.50% 17 - 13.09.27	500 000	EUR	507 468	498 410	0,02
ICADE 1.625% 18 - 28.02.28	300 000	EUR	317 014	300 423	0,01
ICADE 1.875% 15 - 14.09.22	500 000	EUR	517 981	513 205	0,02
Icade Sante SAS 0.875% 19 - 11.04.29	600 000	EUR	573 336	552 312	0,02
Imerys SA 0.875% 16 - 31.03.22	200 000	EUR	200 882	197 820	0,01
Imerys SA 1.50% 17 - 15.01.27	200 000	EUR	195 702	192 656	0,01
Imerys SA 1.50% 17 - 15.01.27	200 000	EUR	186 858	192 656	0,01
Imerys SA 1.875% 16 - 31.03.28	300 000	EUR	303 574	291 543	0,01
Imerys SA 2.00% 14 - 12.10.24	700 000	EUR	716 923	710 514	0,03
Indigo Group SAS 1.625% 18 - 19.04.28	1 000 000	EUR	994 592	951 720	0,04
Indigo Group SAS 2.125% 14 - 16.04.25	500 000	EUR	524 617	513 230	0,02
In'li SA 1.125% 19 - 07.02.29	400 000	EUR	416 667	398 632	0,02
JCDecaux SA 1.00% 16 - 06.01.23	700 000	EUR	706 862	688 058	0,03
JCDecaux SA 2.00% 20 - 24.10.24	400 000	EUR	398 839	404 176	0,02
JCDecaux SA 2.625% 20 - 24.04.28	300 000	EUR	300 501	304 611	0,01
Kering SA 0.25% 20 - 13.05.23	1 000 000	EUR	1 000 543	1 005 490	0,05
Kering SA 0.75% 20 - 13.05.28	800 000	EUR	804 604	815 320	0,04
Kering SA 1.25% 16 - 05.10.26	300 000	EUR	316 188	315 744	0,01
Kering SA 1.375% 14 - 10.01.21	300 000	EUR	305 981	304 743	0,01
Kering SA 1.50% 17 - 04.05.27	200 000	EUR	199 812	214 328	0,01
Kering SA 2.75% 14 - 04.08.24	300 000	EUR	327 641	329 484	0,02
Klepierre SA 0.625% 19 - 07.01.30	800 000	EUR	791 859	746 480	0,03
Klepierre SA 1.00% 15 - 17.04.23	900 000	EUR	906 798	901 701	0,04
Klepierre SA 1.25% 16 - 29.09.31	500 000	EUR	520 034	484 430	0,02
Klepierre SA 1.375% 17 - 16.02.27	500 000	EUR	529 802	503 330	0,02
Klepierre SA 1.625% 17 - 13.12.32	200 000	EUR	219 180	199 414	0,01
Klepierre SA 1.75% 14 - 11.06.24	200 000	EUR	207 840	207 068	0,01
Klepierre SA 1.875% 16 - 19.02.26	600 000	EUR	629 301	625 626	0,03
Klepierre SA 2.00% 20 - 05.12.29	900 000	EUR	903 324	939 942	0,04
La Mondiale SAM 2.125% 20 - 23.06.31	100 000	EUR	99 574	99 078	0,00
La Mondiale SAM FRN 14 - 29.12.49	753 000	EUR	839 922	830 589	0,04
Legrand SA 0.50% 17 - 10.09.23	600 000	EUR	597 652	605 706	0,03
Legrand SA 0.625% 19 - 24.06.28	400 000	EUR	399 729	403 516	0,02
Legrand SA 0.75% 20 - 20.05.30	800 000	EUR	801 518	811 480	0,04
Legrand SA 1.00% 18 - 03.06.26	300 000	EUR	305 119	310 131	0,01
Legrand SA 1.875% 15 - 16.12.27	200 000	EUR	213 215	218 670	0,01
Legrand SA 1.875% 17 - 07.06.32	400 000	EUR	447 960	453 032	0,02
Legrand SA 3.375% 12 - 19.04.22	200 000	EUR	211 031	210 948	0,01
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE Zero Coupon 20 - 02.11.24	1 100 000	EUR	1 097 409	1 093 587	0,05
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE Zero Coupon 20 - 02.11.24	400 000	EUR	396 607	397 668	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE Zero Coupon 20 - 02.11.26	1 100 000	EUR	1 086 822	1 085 172	0,05
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.125% 20 - 02.11.28	2 000 000	EUR	1 969 978	1 964 080	0,09
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.375% 17 - 26.05.22	502 000	EUR	504 843	504 555	0,02
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.375% 20 - 02.11.31	1 500 000	EUR	1 468 438	1 470 975	0,07
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.75% 17 - 26.05.24	590 000	EUR	598 413	603 027	0,03
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.75% 20 - 04.07.25	800 000	EUR	818 963	819 696	0,04
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.75% 20 - 04.07.25	400 000	EUR	409 679	409 848	0,02
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.125% 19 - 28.02.23	1 000 000	EUR	1 001 793	1 001 240	0,05
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 1.00% 14 - 24.09.21	255 000	EUR	258 189	257 614	0,01
Mercialys SA 1.787% 14 - 31.03.23	600 000	EUR	617 375	584 994	0,03
Mercialys SA 1.80% 18 - 27.02.26	200 000	EUR	186 318	176 258	0,01
Orange SA Zero Coupon 19 - 09.04.26	600 000	EUR	600 005	585 042	0,03
Orange SA Zero Coupon 19 - 09.04.26	400 000	EUR	389 478	390 028	0,02
Orange SA 0.50% 19 - 15.01.22	300 000	EUR	302 361	301 851	0,01
Orange SA 0.50% 19 - 09.04.32	500 000	EUR	497 947	478 475	0,02
Orange SA 0.50% 19 - 09.04.32	500 000	EUR	460 322	478 475	0,02
Orange SA 0.75% 17 - 09.11.23	800 000	EUR	815 659	813 296	0,04
Orange SA 0.875% 16 - 02.03.27	600 000	EUR	604 396	617 442	0,03
Orange SA 1.00% 16 - 05.12.25	600 000	EUR	607 564	618 330	0,03
Orange SA 1.00% 18 - 09.12.25	1 100 000	EUR	1 134 495	1 135 035	0,05
Orange SA 1.125% 19 - 15.07.24	1 200 000	EUR	1 232 308	1 234 932	0,06
Orange SA 1.20% 19 - 07.11.34	100 000	EUR	103 193	98 658	0,00
Orange SA 1.25% 20 - 07.07.27	800 000	EUR	845 707	841 104	0,04
Orange SA 1.375% 18 - 16.01.30	500 000	EUR	526 685	536 840	0,02
Orange SA 1.375% 18 - 20.03.28	800 000	EUR	832 699	851 488	0,04
Orange SA 1.375% 19 - 09.04.49	500 000	EUR	492 296	479 225	0,02
Orange SA 1.375% 19 - 09.04.49	100 000	EUR	94 178	95 845	0,00
Orange SA 1.50% 17 - 09.09.27	300 000	EUR	319 872	321 825	0,01
Orange SA 1.625% 20 - 04.07.32	1 300 000	EUR	1 412 092	1 410 552	0,06
Orange SA FRN 19 - 31.12.99	500 000	EUR	491 817	487 785	0,02
Orange SA 1.875% 18 - 09.12.30	1 400 000	EUR	1 535 373	1 571 080	0,07
Orange SA 2.00% 19 - 15.01.29	1 200 000	EUR	1 287 608	1 341 816	0,06
Orange SA FRN 19 - 31.12.99	900 000	EUR	925 193	911 034	0,04
Orange SA 2.50% 12 - 03.01.23	300 000	EUR	315 863	318 363	0,01
Orange SA 3.00% 12 - 15.06.22	1 000 000	EUR	1 054 749	1 058 540	0,05
Orange SA 3.125% 13 - 01.09.24	700 000	EUR	769 974	770 693	0,03
Orange SA 3.375% 10 - 16.09.22	300 000	EUR	323 977	321 654	0,01
Orange SA FRN 14 - 29.10.49	800 000	EUR	828 110	823 824	0,04
Orange SA FRN 14 - 29.10.49	1 097 000	EUR	1 281 773	1 269 854	0,06

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Orange SA FRN 14 - 29.12.49	1 200 000	EUR	1 324 894	1 337 352	0,06
Orange SA 8.125% 03 - 28.01.33	1 149 000	EUR	2 049 864	2 082 057	0,09
Pernod Ricard SA Zero Coupon 19 - 24.10.23	300 000	EUR	300 308	297 318	0,01
Pernod Ricard SA Zero Coupon 19 - 24.10.23	500 000	EUR	494 754	495 530	0,02
Pernod Ricard SA 0.50% 19 - 24.10.27	300 000	EUR	301 338	299 394	0,01
Pernod Ricard SA 0.50% 19 - 24.10.27	100 000	EUR	100 690	99 798	0,00
Pernod Ricard SA 0.875% 19 - 24.10.31	200 000	EUR	202 968	198 114	0,01
Pernod Ricard SA 0.875% 19 - 24.10.31	200 000	EUR	201 746	198 114	0,01
Pernod Ricard SA 1.125% 20 - 04.07.25	600 000	EUR	613 914	619 506	0,03
Pernod Ricard SA 1.50% 16 - 18.05.26	100 000	EUR	106 303	105 803	0,01
Pernod Ricard SA 1.75% 20 - 04.08.30	1 100 000	EUR	1 180 725	1 192 807	0,05
Pernod Ricard SA 1.875% 15 - 28.09.23	900 000	EUR	941 331	945 909	0,04
Pernod Ricard SA 2.125% 14 - 27.09.24	600 000	EUR	643 846	642 678	0,03
Peugeot SA 1.125% 19 - 18.09.29	400 000	EUR	399 513	362 980	0,02
Peugeot SA 2.00% 17 - 23.03.24	770 000	EUR	791 094	780 095	0,04
Peugeot SA 2.00% 18 - 20.03.25	600 000	EUR	623 160	600 396	0,03
Peugeot SA 2.375% 16 - 14.04.23	300 000	EUR	313 838	305 238	0,01
Peugeot SA 2.75% 20 - 15.05.26	1 200 000	EUR	1 204 109	1 219 908	0,05
PSA Banque France SA 0.50% 19 - 04.12.22	543 000	EUR	544 129	535 279	0,02
PSA Banque France SA 0.625% 17 - 10.10.22	450 000	EUR	447 235	441 833	0,02
PSA Banque France SA 0.625% 19 - 21.06.24	436 000	EUR	426 919	420 326	0,02
PSA Banque France SA 0.75% 18 - 19.04.23	379 000	EUR	378 053	371 386	0,02
PSA Tresorerie GIE 6.00% 03 - 19.09.33	580 000	EUR	735 074	755 119	0,03
Publicis Groupe SA 0.50% 16 - 11.03.23	600 000	EUR	603 461	596 646	0,03
Publicis Groupe SA 1.125% 14 - 16.12.21	700 000	EUR	709 538	705 873	0,03
Publicis Groupe SA 1.625% 14 - 16.12.24	500 000	EUR	516 402	516 985	0,02
RCI Banque SA 0.25% 18 - 07.12.21	600 000	EUR	599 952	591 054	0,03
RCI Banque SA 0.25% 19 - 03.08.23	1 000 000	EUR	987 330	964 030	0,04
RCI Banque SA 0.50% 16 - 15.09.23	611 000	EUR	604 236	591 118	0,03
RCI Banque SA 0.625% 16 - 11.10.21	450 000	EUR	452 176	442 472	0,02
RCI Banque SA 0.75% 17 - 01.12.22	826 000	EUR	832 457	812 834	0,04
RCI Banque SA 0.75% 17 - 26.09.22	609 000	EUR	611 829	593 915	0,03
RCI Banque SA 0.75% 19 - 04.10.23	670 000	EUR	672 727	650 965	0,03
RCI Banque SA 1.00% 16 - 17.05.23	350 000	EUR	349 461	344 502	0,02
RCI Banque SA 1.125% 20 - 15.01.27	810 000	EUR	798 541	761 416	0,03
RCI Banque SA 1.25% 15 - 06.08.22	600 000	EUR	608 770	593 466	0,03
RCI Banque SA 1.375% 17 - 03.08.24	844 000	EUR	855 901	836 252	0,04
RCI Banque SA 1.625% 17 - 04.11.25	450 000	EUR	439 878	447 543	0,02
RCI Banque SA 1.625% 18 - 26.05.26	624 000	EUR	624 692	608 987	0,03
RCI Banque SA 1.75% 19 - 04.10.26	700 000	EUR	701 908	692 503	0,03
RCI Banque SA 2.00% 19 - 07.11.24	700 000	EUR	692 374	704 914	0,03
SANEF SA 0.95% 16 - 19.10.28	200 000	EUR	188 942	185 570	0,01
SANEF SA 1.875% 15 - 16.03.26	400 000	EUR	430 266	411 576	0,02
Sanofi Zero Coupon 16 - 13.09.22	500 000	EUR	501 396	500 735	0,02
Sanofi Zero Coupon 19 - 21.03.22	800 000	EUR	803 484	801 360	0,04
Sanofi 0.50% 16 - 13.01.27	1 000 000	EUR	1 005 794	1 024 860	0,05
Sanofi 0.50% 18 - 21.03.23	1 900 000	EUR	1 920 755	1 928 177	0,09
Sanofi 0.625% 16 - 04.05.24	600 000	EUR	615 218	614 766	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Sanofi 0.875% 15 - 22.09.21	400 000	EUR	404 975	403 540	0,02
Sanofi 0.875% 19 - 21.03.29	500 000	EUR	515 551	526 805	0,02
Sanofi 1.00% 18 - 21.03.26	1 900 000	EUR	1 983 653	2 001 916	0,09
Sanofi 1.00% 20 - 04.01.25	1 100 000	EUR	1 136 925	1 148 972	0,05
Sanofi 1.125% 14 - 03.10.22	500 000	EUR	509 401	508 925	0,02
Sanofi 1.125% 16 - 04.05.28	500 000	EUR	529 702	536 160	0,02
Sanofi 1.25% 19 - 21.03.34	600 000	EUR	648 871	665 568	0,03
Sanofi 1.375% 18 - 21.03.30	1 700 000	EUR	1 817 625	1 876 392	0,08
Sanofi 1.50% 15 - 22.09.25	500 000	EUR	526 222	537 305	0,02
Sanofi 1.50% 20 - 04.01.30	1 100 000	EUR	1 183 454	1 222 100	0,05
Sanofi 1.75% 14 - 09.10.26	1 200 000	EUR	1 287 765	1 320 288	0,06
Sanofi 1.875% 18 - 21.03.38	1 100 000	EUR	1 237 141	1 310 078	0,06
Sanofi 2.50% 13 - 14.11.23	900 000	EUR	971 450	972 891	0,04
Schlumberger Finance France SAS 1.00% 18 - 18.02.26	678 000	EUR	685 640	687 228	0,03
Schneider Electric SE Zero Coupon 20 - 06.12.23	100 000	EUR	99 764	99 998	0,00
Schneider Electric SE 0.25% 16 - 09.09.24	1 400 000	EUR	1 414 747	1 407 980	0,06
Schneider Electric SE 0.25% 20 - 03.11.29	600 000	EUR	570 286	590 292	0,03
Schneider Electric SE 0.875% 15 - 03.11.25	600 000	EUR	611 823	620 772	0,03
Schneider Electric SE 0.875% 17 - 13.12.26	300 000	EUR	306 380	312 345	0,01
Schneider Electric SE 1.00% 20 - 04.09.27	800 000	EUR	830 396	840 312	0,04
Schneider Electric SE 1.375% 18 - 21.06.27	400 000	EUR	423 625	430 832	0,02
Schneider Electric SE 1.50% 15 - 09.08.23	700 000	EUR	732 387	729 701	0,03
Schneider Electric SE 1.50% 19 - 15.01.28	700 000	EUR	748 116	761 446	0,03
Schneider Electric SE 2.50% 13 - 09.06.21	600 000	EUR	617 427	617 148	0,03
SCOR SE FRN 15 - 06.08.46	500 000	EUR	526 629	548 800	0,02
SCOR SE FRN 16 - 27.05.48	100 000	EUR	119 265	114 703	0,01
SCOR SE FRN 16 - 27.05.48	300 000	EUR	351 006	344 109	0,02
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 18 - 29.05.25	200 000	EUR	206 486	206 786	0,01
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 20 - 06.05.27	1 000 000	EUR	1 010 870	1 027 560	0,05
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.875% 14 - 26.11.21	200 000	EUR	204 182	202 570	0,01
Societe Generale SA Zero Coupon 19 - 27.05.22	1 300 000	EUR	1 301 457	1 296 009	0,06
Societe Generale SA 0.125% 16 - 10.05.21	600 000	EUR	601 886	600 306	0,03
Societe Generale SA 0.125% 20 - 24.02.26	1 000 000	EUR	979 212	987 530	0,04
Societe Generale SA 0.125% 20 - 24.02.26	600 000	EUR	593 801	592 518	0,03
Societe Generale SA 0.25% 18 - 18.01.22	1 700 000	EUR	1 701 590	1 704 335	0,08
Societe Generale SA 0.50% 17 - 13.01.23	800 000	EUR	793 261	794 568	0,04
Societe Generale SA 0.75% 16 - 26.05.23	800 000	EUR	809 181	812 872	0,04
Societe Generale SA 0.75% 20 - 25.01.27	1 800 000	EUR	1 792 413	1 755 576	0,08
Societe Generale SA 0.875% 19 - 07.01.26	500 000	EUR	505 744	494 635	0,02
Societe Generale SA 0.875% 19 - 24.09.29	800 000	EUR	774 067	775 360	0,03
Societe Generale SA 1.00% 16 - 04.01.22	1 000 000	EUR	1 010 639	1 008 420	0,05
Societe Generale SA 1.125% 18 - 23.01.25	800 000	EUR	817 137	806 504	0,04
Societe Generale SA FRN 20 - 21.04.26	1 000 000	EUR	994 642	1 000 110	0,04
Societe Generale SA 1.25% 19 - 15.02.24	1 400 000	EUR	1 413 925	1 417 836	0,06
Societe Generale SA 1.25% 20 - 06.12.30	200 000	EUR	198 961	200 358	0,01
Societe Generale SA 1.375% 17 - 13.01.28	600 000	EUR	624 362	609 456	0,03
Societe Generale SA FRN 18 - 23.02.28	1 000 000	EUR	1 007 278	995 390	0,04
Societe Generale SA 1.75% 19 - 22.03.29	1 000 000	EUR	1 047 313	1 044 800	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Societe Generale SA 2.125% 18 - 27.09.28	1 000 000	EUR	1 038 877	1 072 580	0,05
Societe Generale SA FRN 14 - 16.09.26	700 000	EUR	712 105	704 242	0,03
Societe Generale SA 2.625% 15 - 27.02.25	1 100 000	EUR	1 166 610	1 172 105	0,05
Societe Generale SA 4.00% 13 - 06.07.23	700 000	EUR	735 537	761 635	0,03
Societe Generale SA 4.00% 13 - 06.07.23	300 000	EUR	324 478	326 415	0,01
Societe Generale SA 4.25% 12 - 13.07.22	700 000	EUR	762 883	756 623	0,03
Sodexo SA 0.75% 16 - 14.04.27	600 000	EUR	589 108	597 822	0,03
Sodexo SA 0.75% 20 - 27.04.25	758 000	EUR	759 646	759 698	0,03
Sodexo SA 1.00% 20 - 27.04.29	838 000	EUR	830 804	825 656	0,04
Sodexo SA 1.125% 18 - 22.05.25	100 000	EUR	100 439	102 591	0,00
Sodexo SA 1.75% 14 - 24.01.22	1 049 000	EUR	1 076 954	1 070 966	0,05
Sodexo SA 2.50% 14 - 24.06.26	392 000	EUR	445 660	434 046	0,02
Sogecap SA FRN 14 - 29.12.49	900 000	EUR	955 499	948 771	0,04
Suez SA 0.50% 19 - 14.10.31	700 000	EUR	693 426	682 472	0,03
Suez SA 1.00% 17 - 04.03.25	1 000 000	EUR	1 020 877	1 030 500	0,05
Suez SA 1.25% 16 - 19.05.28	900 000	EUR	954 953	946 287	0,04
Suez SA 1.25% 20 - 04.02.27	1 000 000	EUR	1 022 410	1 049 720	0,05
Suez SA 1.25% 20 - 14.05.35	900 000	EUR	900 398	914 598	0,04
Suez SA 1.50% 17 - 04.03.29	600 000	EUR	618 210	646 296	0,03
Suez SA 1.625% 17 - 21.09.32	100 000	EUR	107 983	109 271	0,01
Suez SA 1.625% 18 - 17.09.30	400 000	EUR	436 537	437 664	0,02
Suez SA FRN 19 - 31.12.99	300 000	EUR	298 648	281 349	0,01
Suez SA FRN 19 - 31.12.99	100 000	EUR	93 528	93 783	0,00
Suez SA 1.75% 15 - 09.10.25	600 000	EUR	638 934	641 376	0,03
Suez SA FRN 15 - 29.12.49	300 000	EUR	295 373	300 000	0,01
Suez SA 2.75% 13 - 10.09.23	200 000	EUR	218 883	216 800	0,01
Suez SA FRN 17 - 31.12.99	600 000	EUR	629 950	604 488	0,03
Suez SA 4.125% 10 - 24.06.22	800 000	EUR	869 649	865 040	0,04
Suez SA 5.50% 09 - 22.07.24	100 000	EUR	119 010	121 274	0,01
TDF Infrastructure SAS 2.50% 16 - 04.07.26	900 000	EUR	927 536	919 755	0,04
TDF Infrastructure SAS 2.875% 15 - 19.10.22	500 000	EUR	513 712	513 355	0,02
Teleperformance 1.50% 17 - 04.03.24	500 000	EUR	511 194	506 970	0,02
Teleperformance 1.875% 18 - 07.02.25	600 000	EUR	619 738	621 768	0,03
Terega SA 2.20% 15 - 08.05.25	200 000	EUR	213 289	211 952	0,01
Terega SA 4.339% 11 - 07.07.21	400 000	EUR	417 139	415 248	0,02
Terega SASU 0.625% 20 - 27.02.28	600 000	EUR	567 910	563 322	0,03
Thales SA Zero Coupon 19 - 31.05.22	700 000	EUR	700 427	696 815	0,03
Thales SA 0.25% 20 - 29.01.27	500 000	EUR	489 863	493 785	0,02
Thales SA 0.75% 16 - 06.07.23	500 000	EUR	510 234	506 380	0,02
Thales SA 0.75% 18 - 23.01.25	500 000	EUR	506 963	508 470	0,02
Thales SA 0.875% 18 - 19.04.24	200 000	EUR	202 160	204 046	0,01
Thales SA 1.00% 20 - 15.05.28	900 000	EUR	905 264	923 922	0,04
Tikehau Capital SCA 2.25% 19 - 14.10.26	600 000	EUR	600 003	585 864	0,03
Total Capital International SA 0.25% 16 - 07.12.23	1 200 000	EUR	1 203 483	1 206 216	0,05
Total Capital International SA 0.625% 17 - 10.04.24	600 000	EUR	612 481	611 826	0,03
Total Capital International SA 0.696% 19 - 31.05.28	900 000	EUR	923 034	913 833	0,04
Total Capital International SA 0.75% 16 - 07.12.28	1 100 000	EUR	1 087 329	1 121 417	0,05
Total Capital International SA 0.952% 20 - 18.05.31	800 000	EUR	816 015	821 208	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Total Capital International SA 1.023% 18 - 03.04.27	800 000	EUR	839 944	833 608	0,04
Total Capital International SA 1.375% 14 - 19.03.25	600 000	EUR	625 721	633 156	0,03
Total Capital International SA 1.375% 17 - 10.04.29	600 000	EUR	632 610	645 420	0,03
Total Capital International SA 1.491% 18 - 09.04.30	600 000	EUR	642 703	651 486	0,03
Total Capital International SA 1.491% 20 - 04.08.27	1 600 000	EUR	1 691 653	1 705 648	0,08
Total Capital International SA 1.535% 19 - 31.05.39	500 000	EUR	529 002	526 475	0,02
Total Capital International SA 1.618% 20 - 18.05.40	1 100 000	EUR	1 150 136	1 147 619	0,05
Total Capital International SA 1.994% 20 - 04.08.32	1 300 000	EUR	1 444 408	1 465 594	0,07
Total Capital International SA 2.125% 12 - 15.03.23	700 000	EUR	732 691	738 129	0,03
Total Capital International SA 2.125% 13 - 19.11.21	500 000	EUR	514 935	513 875	0,02
Total Capital International SA 2.50% 14 - 25.03.26	400 000	EUR	437 699	449 812	0,02
Total Capital International SA 2.50% 14 - 25.03.26	400 000	EUR	446 556	449 812	0,02
Total Capital International SA 2.875% 13 - 19.11.25	600 000	EUR	696 169	682 410	0,03
Total Capital SA 5.125% 09 - 26.03.24	670 000	EUR	793 947	793 454	0,04
TOTAL SA FRN 19 - 31.12.99	1 830 000	EUR	1 835 028	1 808 223	0,08
TOTAL SA FRN 15 - 29.12.49	915 000	EUR	944 313	935 587	0,04
TOTAL SA FRN 15 - 29.12.49	1 300 000	EUR	1 373 640	1 329 250	0,06
TOTAL SA FRN 15 - 29.12.49	100 000	EUR	108 569	102 250	0,00
TOTAL SA FRN 16 - 29.12.49	1 166 000	EUR	1 209 590	1 188 084	0,05
TOTAL SA FRN 16 - 29.12.49	1 177 000	EUR	1 296 308	1 252 528	0,06
TOTAL SA FRN 16 - 29.12.49	1 895 000	EUR	2 001 933	1 959 335	0,09
UMG Groupe VYV 1.625% 19 - 07.02.29	700 000	EUR	686 016	709 163	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 0.875% 16 - 21.02.25	650 000	EUR	650 765	641 322	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 0.875% 19 - 29.03.32	700 000	EUR	685 703	619 507	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.00% 19 - 27.02.27	700 000	EUR	686 045	678 769	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.125% 16 - 28.04.27	379 000	EUR	400 106	370 166	0,02
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.125% 18 - 15.09.25	500 000	EUR	509 782	495 105	0,02
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.375% 15 - 15.04.30	600 000	EUR	606 700	581 820	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.50% 17 - 22.02.28	471 000	EUR	491 663	468 235	0,02
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.50% 17 - 29.05.29	492 000	EUR	499 121	482 027	0,02
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.75% 19 - 27.02.34	700 000	EUR	700 755	674 569	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.75% 19 - 07.01.49	400 000	EUR	413 977	344 696	0,02
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.875% 18 - 15.01.31	800 000	EUR	845 224	801 016	0,04
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.00% 16 - 28.04.36	650 000	EUR	699 198	636 460	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.00% 17 - 29.05.37	200 000	EUR	217 736	193 652	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. FRN 18 - 31.12.99	1 300 000	EUR	1 213 199	1 134 250	0,05
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.125% 20 - 04.09.25	900 000	EUR	913 890	932 481	0,04
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.25% 18 - 14.05.38	300 000	EUR	293 656	299 268	0,01
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.50% 13 - 06.12.23	200 000	EUR	204 196	207 752	0,01
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.50% 14 - 26.02.24	400 000	EUR	420 843	419 788	0,02
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.625% 20 - 04.09.30	700 000	EUR	719 362	750 281	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. FRN 18 - 31.12.99	1 000 000	EUR	971 773	880 230	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 15 - 14.03.25	500 000	EUR	525 246	495 140	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 14 - 17.10.22	450 000	EUR	464 666	453 447	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 16 - 03.09.26	903 000	EUR	919 060	904 571	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.50% 14 - 06.04.26	460 000	EUR	491 374	486 082	0,02
Valeo SA 0.375% 17 - 09.12.22	800 000	EUR	794 161	774 184	0,03
Valeo SA 0.625% 17 - 01.11.23	300 000	EUR	299 666	290 442	0,01
Valeo SA 1.50% 18 - 18.06.25	500 000	EUR	511 667	475 675	0,02
Valeo SA 1.625% 16 - 18.03.26	700 000	EUR	712 842	670 558	0,03
Valeo SA 3.25% 14 - 22.01.24	600 000	EUR	639 787	617 370	0,03
Veolia Environnement SA 0.314% 16 - 10.04.23	800 000	EUR	805 658	803 128	0,04
Veolia Environnement SA 0.664% 20 - 15.01.31	700 000	EUR	688 998	692 027	0,03
Veolia Environnement SA 0.672% 17 - 30.03.22	600 000	EUR	605 623	603 804	0,03
Veolia Environnement SA 0.80% 20 - 15.01.32	100 000	EUR	100 000	100 400	0,00
Veolia Environnement SA 0.892% 19 - 14.01.24	800 000	EUR	814 162	816 424	0,04
Veolia Environnement SA 0.927% 16 - 01.04.29	100 000	EUR	99 093	102 600	0,00
Veolia Environnement SA 1.25% 20 - 15.04.28	800 000	EUR	835 849	840 680	0,04
Veolia Environnement SA 1.496% 17 - 30.11.26	800 000	EUR	846 511	855 816	0,04
Veolia Environnement SA 1.59% 15 - 01.10.28	400 000	EUR	417 129	431 888	0,02
Veolia Environnement SA 1.94% 18 - 01.07.30	800 000	EUR	851 336	891 008	0,04
Veolia Environnement SA 4.625% 12 - 30.03.27	500 000	EUR	651 056	638 765	0,03
Veolia Environnement SA 5.125% 07 - 24.05.22	750 000	EUR	817 714	817 372	0,04
Veolia Environnement SA 6.125% 03 - 25.11.33	549 000	EUR	909 008	897 642	0,04
Vinci SA 1.00% 18 - 26.09.25	600 000	EUR	619 444	626 004	0,03
Vinci SA 1.625% 19 - 18.01.29	700 000	EUR	740 235	766 920	0,03
Vinci SA 1.75% 18 - 26.09.30	500 000	EUR	537 833	562 040	0,03
Vivendi SA Zero Coupon 19 - 13.06.22	1 100 000	EUR	1 093 171	1 091 497	0,05
Vivendi SA 0.625% 19 - 06.11.25	700 000	EUR	703 928	698 481	0,03
Vivendi SA 0.875% 17 - 18.09.24	500 000	EUR	507 713	506 690	0,02
Vivendi SA 1.125% 16 - 24.11.23	800 000	EUR	829 102	817 112	0,04
Vivendi SA 1.125% 19 - 12.11.28	900 000	EUR	908 499	906 480	0,04
Vivendi SA 1.875% 16 - 26.05.26	100 000	EUR	105 844	106 388	0,01
Wendel SE 1.00% 16 - 20.04.23	400 000	EUR	406 148	403 040	0,02
Wendel SE 1.375% 19 - 26.04.26	100 000	EUR	99 868	99 940	0,00
Wendel SE 1.375% 19 - 26.04.26	400 000	EUR	395 852	399 760	0,02
Wendel SE 2.50% 15 - 02.09.27	400 000	EUR	423 928	420 344	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Wendel SE 2.75% 14 - 10.02.24	400 000	EUR	422 365	427 672	0,02
Worldline SA 0.25% 19 - 18.09.24	300 000	EUR	299 587	295 056	0,01
Worldline SA 0.25% 19 - 18.09.24	400 000	EUR	395 155	393 408	0,02
WPP Finance SA 2.25% 14 - 22.09.26	300 000	EUR	311 597	309 228	0,01
WPP Finance SA 2.375% 20 - 19.05.27	611 000	EUR	610 883	627 845	0,03
			467 741 702	468 385 673	20,91
Allemagne					
Aareal Bank AG 0.375% 19 - 04.10.24	300 000	EUR	301 405	299 124	0,01
Albemarle New Holdings GmbH 1.125% 19 - 25.11.25	607 000	EUR	592 171	596 250	0,03
Albemarle New Holdings GmbH 1.625% 19 - 25.11.28	264 000	EUR	266 336	252 410	0,01
Allianz SE FRN 19 - 25.09.49	500 000	EUR	500 313	481 385	0,02
Allianz SE FRN 19 - 25.09.49	400 000	EUR	360 766	385 108	0,02
Allianz SE FRN 20 - 07.08.50	800 000	EUR	818 104	811 152	0,04
Allianz SE FRN 20 - 07.08.50	100 000	EUR	102 206	101 394	0,00
Allianz SE FRN 15 - 07.07.45	400 000	EUR	434 333	416 556	0,02
Allianz SE FRN 15 - 07.07.45	1 100 000	EUR	1 132 462	1 145 529	0,05
Allianz SE FRN 17 - 07.06.47	500 000	EUR	532 859	552 935	0,03
Allianz SE FRN 17 - 07.06.47	300 000	EUR	346 584	331 761	0,02
Allianz SE FRN 14 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 617 539	1 588 770	0,07
Allianz SE FRN 13 - 31.12.49	700 000	EUR	796 834	768 810	0,03
Allianz SE FRN 13 - 31.12.49	1 000 000	EUR	1 117 366	1 098 300	0,05
Allianz SE FRN 12 - 17.10.42	1 800 000	EUR	2 039 084	1 979 820	0,09
alstria office REIT-AG 0.50% 19 - 26.09.25	300 000	EUR	290 622	288 936	0,01
alstria office REIT-AG 1.50% 17 - 15.11.27	300 000	EUR	307 665	296 082	0,01
alstria office REIT-AG 2.125% 16 - 04.12.23	200 000	EUR	206 855	204 816	0,01
Amphenol Technologies Holding GmbH 0.75% 20 - 05.04.26	707 000	EUR	700 214	706 385	0,03
Amphenol Technologies Holding GmbH 2.00% 18 - 10.08.28	392 000	EUR	430 849	423 928	0,02
BASF SE 0.101% 20 - 06.05.23	800 000	EUR	801 008	801 248	0,04
BASF SE 0.25% 20 - 06.05.27	400 000	EUR	399 179	402 100	0,02
BASF SE 0.25% 20 - 06.05.27	400 000	EUR	401 551	402 100	0,02
BASF SE 0.875% 16 - 10.06.31	615 000	EUR	603 389	637 122	0,03
BASF SE 0.875% 17 - 15.11.27	1 287 000	EUR	1 327 950	1 355 275	0,06
BASF SE 0.875% 18 - 22.05.25	296 000	EUR	301 441	308 503	0,01
BASF SE 1.45% 17 - 13.12.32	100 000	EUR	113 723	108 273	0,01
BASF SE 1.50% 18 - 22.05.30	677 000	EUR	741 331	748 823	0,03
BASF SE 1.625% 17 - 15.11.37	674 000	EUR	715 246	747 864	0,03
BASF SE 2.00% 12 - 12.05.22	1 157 000	EUR	1 213 343	1 212 455	0,05
BASF SE 2.50% 14 - 22.01.24	500 000	EUR	540 402	540 660	0,02
Bayer AG FRN 15 - 04.02.75	1 597 000	EUR	1 589 599	1 584 847	0,07
Bayer AG FRN 19 - 11.12.79	900 000	EUR	884 626	873 828	0,04
Bayer AG FRN 19 - 11.12.79	700 000	EUR	702 677	693 252	0,03
Bayer AG FRN 14 - 07.01.74	701 000	EUR	756 967	725 486	0,03
Bayer AG FRN 14 - 07.01.74	595 000	EUR	612 583	615 783	0,03
Berlin Hyp AG 0.375% 18 - 28.08.23	600 000	EUR	605 335	607 428	0,03
Berlin Hyp AG 0.50% 16 - 26.09.23	300 000	EUR	304 310	301 746	0,01
Berlin Hyp AG 0.50% 19 - 11.05.29	200 000	EUR	191 959	200 132	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Berlin Hyp AG 1.00% 19 - 02.05.26	600 000	EUR	622 358	627 102	0,03
Berlin Hyp AG 1.125% 17 - 25.10.27	400 000	EUR	409 891	410 312	0,02
Berlin Hyp AG 1.25% 15 - 22.01.25	600 000	EUR	615 527	620 010	0,03
Berlin Hyp AG 1.50% 18 - 18.04.28	300 000	EUR	309 014	317 292	0,01
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.125% 16 - 27.04.26	100 000	EUR	99 526	104 037	0,00
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.25% 18 - 29.09.25	700 000	EUR	728 790	728 903	0,03
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.50% 20 - 15.05.30	900 000	EUR	898 415	927 405	0,04
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.75% 14 - 14.10.24	300 000	EUR	315 158	318 489	0,01
Bertelsmann SE & Co. KGaA 2.00% 20 - 04.01.28	800 000	EUR	822 625	864 872	0,04
Bertelsmann SE & Co. KGaA 2.625% 12 - 08.02.22	400 000	EUR	420 772	421 492	0,02
Commerzbank AG 0.25% 19 - 16.09.24	600 000	EUR	571 827	573 330	0,03
Commerzbank AG 0.50% 16 - 13.09.23	826 000	EUR	817 122	811 314	0,04
Commerzbank AG 0.50% 18 - 28.08.23	1 254 000	EUR	1 255 731	1 254 727	0,06
Commerzbank AG 0.50% 18 - 12.06.21	900 000	EUR	904 384	904 104	0,04
Commerzbank AG 0.50% 19 - 12.04.26	735 000	EUR	737 725	724 107	0,03
Commerzbank AG 0.625% 19 - 28.08.24	900 000	EUR	908 233	899 622	0,04
Commerzbank AG 0.875% 20 - 22.01.27	800 000	EUR	787 241	766 648	0,03
Commerzbank AG 1.00% 19 - 03.04.26	1 300 000	EUR	1 312 865	1 318 759	0,06
Commerzbank AG 1.125% 17 - 24.05.24	300 000	EUR	290 117	298 992	0,01
Commerzbank AG 1.125% 17 - 19.09.25	500 000	EUR	514 809	496 385	0,02
Commerzbank AG 1.125% 19 - 22.06.26	400 000	EUR	400 123	392 604	0,02
Commerzbank AG 1.25% 18 - 23.10.23	200 000	EUR	200 320	200 900	0,01
Commerzbank AG 1.50% 15 - 21.09.22	750 000	EUR	769 069	759 968	0,03
Commerzbank AG 1.50% 18 - 28.08.28	481 000	EUR	474 170	506 762	0,02
Commerzbank AG 1.875% 18 - 28.02.28	500 000	EUR	509 074	513 935	0,02
Continental AG Zero Coupon 19 - 09.12.23	400 000	EUR	398 556	390 952	0,02
Continental AG 0.375% 19 - 27.06.25	478 000	EUR	463 563	456 509	0,02
Continental AG 2.50% 20 - 27.08.26	911 000	EUR	945 812	960 795	0,04
Covestro AG 0.875% 20 - 02.03.26	70 000	EUR	69 743	69 951	0,00
Covestro AG 1.00% 16 - 10.07.21	400 000	EUR	403 530	402 408	0,02
Covestro AG 1.375% 20 - 06.12.30	80 000	EUR	79 470	79 830	0,00
Covestro AG 1.75% 16 - 25.09.24	500 000	EUR	527 175	522 235	0,02
CRH Finance Germany GmbH 1.75% 14 - 16.07.21	100 000	EUR	101 525	101 125	0,00
Daimler AG Zero Coupon 19 - 02.08.24	611 000	EUR	592 676	587 819	0,03
Daimler AG 0.375% 19 - 11.08.26	510 000	EUR	511 478	481 302	0,02
Daimler AG 0.375% 19 - 11.08.26	400 000	EUR	392 260	377 492	0,02
Daimler AG 0.75% 16 - 05.11.23	659 000	EUR	667 399	661 419	0,03
Daimler AG 0.75% 19 - 02.08.30	940 000	EUR	928 106	868 306	0,04
Daimler AG 0.85% 17 - 28.02.25	20 000	EUR	19 990	19 746	0,00
Daimler AG 0.85% 17 - 28.02.25	977 000	EUR	963 169	964 592	0,04
Daimler AG 1.00% 17 - 15.11.27	1 114 000	EUR	1 096 711	1 079 956	0,05
Daimler AG 1.125% 19 - 08.08.34	507 000	EUR	478 755	468 463	0,02
Daimler AG 1.125% 19 - 11.06.31	400 000	EUR	397 720	380 996	0,02
Daimler AG 1.125% 19 - 11.06.31	566 000	EUR	558 555	539 109	0,02
Daimler AG 1.375% 16 - 05.11.28	1 030 000	EUR	1 027 924	1 033 008	0,05
Daimler AG 1.40% 16 - 01.12.24	1 114 000	EUR	1 132 628	1 131 880	0,05
Daimler AG 1.50% 16 - 03.09.26	785 000	EUR	824 712	797 866	0,04
Daimler AG 1.50% 17 - 07.03.29	860 000	EUR	885 071	868 892	0,04
Daimler AG 1.625% 20 - 22.08.23	814 000	EUR	822 683	831 810	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Daimler AG 1.875% 14 - 07.08.24	542 000	EUR	571 168	559 322	0,03
Daimler AG 2.00% 19 - 27.02.31	630 000	EUR	656 350	658 142	0,03
Daimler AG 2.00% 20 - 22.08.26	1 118 000	EUR	1 135 010	1 164 911	0,05
Daimler AG 2.125% 17 - 07.03.37	1 171 000	EUR	1 232 518	1 221 751	0,05
Daimler AG 2.25% 14 - 24.01.22	700 000	EUR	724 176	721 147	0,03
Daimler AG 2.375% 12 - 09.12.22	692 000	EUR	722 866	719 825	0,03
Daimler AG 2.375% 13 - 03.08.23	400 000	EUR	416 218	418 076	0,02
Daimler AG 2.375% 20 - 22.05.30	611 000	EUR	635 161	646 291	0,03
Daimler AG 2.375% 20 - 22.05.30	496 000	EUR	526 558	524 649	0,02
Daimler AG 2.625% 20 - 04.07.25	1 196 000	EUR	1 272 781	1 273 405	0,06
Daimler AG 2.625% 20 - 04.07.25	300 000	EUR	319 210	319 416	0,01
Deutsche Bank AG 1.125% 15 - 17.03.25	700 000	EUR	688 877	685 223	0,03
Deutsche Bank AG 1.125% 18 - 30.08.23	814 000	EUR	818 899	831 745	0,04
Deutsche Bank AG 1.25% 14 - 09.08.21	700 000	EUR	701 825	700 924	0,03
Deutsche Bank AG FRN 20 - 06.10.26	60 000	EUR	59 963	61 092	0,00
Deutsche Bank AG 1.50% 17 - 20.01.22	1 700 000	EUR	1 716 629	1 706 205	0,08
Deutsche Bank AG 1.625% 20 - 20.01.27	3 200 000	EUR	3 216 779	3 167 168	0,14
Deutsche Bank AG 1.75% 18 - 17.01.28	3 100 000	EUR	2 920 830	3 084 593	0,14
Deutsche Bank AG 1.875% 19 - 14.02.22	400 000	EUR	403 410	403 036	0,02
Deutsche Bank AG 2.375% 13 - 01.11.23	1 100 000	EUR	1 131 867	1 124 893	0,05
Deutsche Bank AG 2.625% 19 - 02.12.26	600 000	EUR	628 987	628 170	0,03
Deutsche Boerse AG 1.125% 18 - 26.03.28	550 000	EUR	570 114	592 185	0,03
Deutsche Boerse AG 1.625% 15 - 10.08.25	350 000	EUR	375 087	382 165	0,02
Deutsche Boerse AG 2.375% 12 - 10.05.22	100 000	EUR	105 913	105 208	0,01
Deutsche Boerse AG 2.375% 12 - 10.05.22	400 000	EUR	421 279	420 832	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.125% 19 - 09.05.24	400 000	EUR	390 113	388 072	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.625% 18 - 23.02.22	900 000	EUR	901 376	890 469	0,04
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.75% 19 - 02.07.23	200 000	EUR	198 961	199 868	0,01
Deutsche Post AG 0.375% 20 - 20.05.26	911 000	EUR	909 481	917 395	0,04
Deutsche Post AG 0.75% 20 - 20.05.29	611 000	EUR	614 282	626 862	0,03
Deutsche Post AG 1.00% 17 - 13.12.27	440 000	EUR	462 796	462 053	0,02
Deutsche Post AG 1.00% 20 - 20.05.32	611 000	EUR	614 924	630 699	0,03
Deutsche Post AG 1.25% 16 - 04.01.26	493 000	EUR	518 795	523 019	0,02
Deutsche Post AG 1.625% 18 - 12.05.28	720 000	EUR	771 343	790 344	0,04
Deutsche Post AG 2.75% 13 - 10.09.23	600 000	EUR	656 456	657 864	0,03
Deutsche Post AG 2.875% 12 - 12.11.24	650 000	EUR	717 654	729 619	0,03
Deutsche Telekom AG 0.50% 19 - 07.05.27	1 338 000	EUR	1 337 774	1 340 810	0,06
Deutsche Telekom AG 0.875% 19 - 25.03.26	900 000	EUR	929 837	925 866	0,04
Deutsche Telekom AG 1.375% 19 - 07.05.34	720 000	EUR	736 758	738 569	0,03
Deutsche Telekom AG 1.75% 19 - 25.03.31	716 000	EUR	752 126	777 476	0,04
Deutsche Telekom AG 1.75% 19 - 25.03.31	300 000	EUR	326 001	325 758	0,01
Deutsche Telekom AG 1.75% 19 - 12.09.49	539 000	EUR	528 001	525 406	0,02
Deutsche Telekom AG 2.25% 19 - 29.03.39	482 000	EUR	512 415	545 879	0,02
Deutsche Wohnen SE 1.00% 20 - 30.04.25	500 000	EUR	502 194	511 305	0,02
Deutsche Wohnen SE 1.00% 20 - 30.04.25	300 000	EUR	302 776	306 783	0,01
Deutsche Wohnen SE 1.50% 20 - 30.04.30	600 000	EUR	608 803	632 814	0,03
DVB Bank SE 1.00% 17 - 25.04.22	300 000	EUR	298 709	299 718	0,01
DVB Bank SE 1.25% 16 - 15.09.21	200 000	EUR	203 059	200 972	0,01
DVB Bank SE 1.25% 16 - 16.06.23	400 000	EUR	401 615	401 056	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
E.ON SE Zero Coupon 19 - 28.08.24	800 000	EUR	801 803	790 904	0,04
E.ON SE Zero Coupon 19 - 24.10.22	1 290 000	EUR	1 290 797	1 284 659	0,06
E.ON SE Zero Coupon 19 - 29.09.22	410 000	EUR	409 227	408 832	0,02
E.ON SE Zero Coupon 20 - 18.12.23	510 000	EUR	503 509	505 497	0,02
E.ON SE Zero Coupon 20 - 18.12.23	200 000	EUR	200 203	198 234	0,01
E.ON SE 0.25% 19 - 24.10.26	753 000	EUR	745 248	747 458	0,03
E.ON SE 0.35% 19 - 28.02.30	470 000	EUR	467 428	455 143	0,02
E.ON SE 0.375% 17 - 23.08.21	580 000	EUR	582 688	580 922	0,03
E.ON SE 0.375% 20 - 29.09.27	880 000	EUR	877 653	877 369	0,04
E.ON SE 0.375% 20 - 20.04.23	1 114 000	EUR	1 114 866	1 118 567	0,05
E.ON SE 0.625% 19 - 11.07.31	670 000	EUR	651 199	656 975	0,03
E.ON SE 0.75% 20 - 18.12.30	640 000	EUR	629 693	642 995	0,03
E.ON SE 0.75% 20 - 20.02.28	707 000	EUR	708 106	719 252	0,03
E.ON SE 0.875% 17 - 22.05.24	600 000	EUR	604 295	613 248	0,03
E.ON SE 0.875% 20 - 20.08.31	407 000	EUR	406 216	410 826	0,02
E.ON SE 1.00% 20 - 10.07.25	1 198 000	EUR	1 240 532	1 240 265	0,06
E.ON SE 1.625% 17 - 22.05.29	600 000	EUR	611 600	649 722	0,03
Eurogrid GmbH 1.113% 20 - 15.05.32	900 000	EUR	926 543	947 520	0,04
Eurogrid GmbH 1.50% 16 - 18.04.28	700 000	EUR	727 350	757 120	0,03
Eurogrid GmbH 1.625% 15 - 11.03.23	1 000 000	EUR	1 037 865	1 045 610	0,05
Eurogrid GmbH 1.875% 15 - 06.10.25	200 000	EUR	211 848	216 014	0,01
Evonik Industries AG 0.625% 20 - 18.09.25	400 000	EUR	399 193	403 908	0,02
Evonik Industries AG 0.625% 20 - 18.09.25	300 000	EUR	301 189	302 931	0,01
Evonik Industries AG 1.00% 15 - 23.01.23	650 000	EUR	662 444	662 363	0,03
Evonik Industries AG FRN 17 - 07.07.77	800 000	EUR	800 367	786 536	0,04
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 0.25% 19 - 29.11.23	808 000	EUR	807 683	802 861	0,04
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 0.625% 19 - 30.11.26	631 000	EUR	629 937	630 470	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.00% 20 - 29.05.26	407 000	EUR	405 916	413 948	0,02
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.25% 19 - 29.11.29	614 000	EUR	618 168	630 578	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 18 - 07.11.25	340 000	EUR	346 735	356 929	0,02
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 20 - 29.05.30	911 000	EUR	914 403	940 854	0,04
Fresenius SE & Co. KGaA 0.75% 20 - 15.01.28	410 000	EUR	407 763	405 757	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 0.75% 20 - 15.01.28	100 000	EUR	101 576	98 965	0,00
Fresenius SE & Co. KGaA 1.625% 20 - 10.08.27	998 000	EUR	1 033 822	1 049 038	0,05
Fresenius SE & Co. KGaA 1.875% 19 - 15.02.25	400 000	EUR	420 073	421 780	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 2.875% 19 - 15.02.29	400 000	EUR	438 628	458 936	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 4.00% 14 - 02.01.24	353 000	EUR	391 756	396 617	0,02
Hamburg Commercial Bank AG 0.50% 19 - 23.05.22	1 000 000	EUR	992 607	974 920	0,04
Hannover Rueck SE 1.125% 18 - 18.04.28	700 000	EUR	736 616	748 902	0,03
Hannover Rueck SE FRN 19 - 10.09.39	400 000	EUR	396 712	382 428	0,02
Hannover Rueck SE FRN 19 - 10.09.39	300 000	EUR	292 075	286 821	0,01
Hannover Rueck SE FRN 20 - 10.08.40	400 000	EUR	397 084	398 108	0,02
Hannover Rueck SE FRN 14 - 29.06.49	500 000	EUR	535 737	538 585	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
HeidelbergCement AG 1.50% 16 - 02.07.25	780 000	EUR	801 838	794 711	0,04
HeidelbergCement AG 2.25% 16 - 30.03.23	698 000	EUR	722 946	723 128	0,03
HeidelbergCement AG 2.25% 16 - 06.03.24	404 000	EUR	418 705	423 893	0,02
Hella GmbH & Co. KGaA 0.50% 19 - 26.01.27	383 000	EUR	380 115	357 760	0,02
Hella GmbH & Co. KGaA 1.00% 17 - 17.05.24	420 000	EUR	417 577	428 203	0,02
Henkel AG & Co. KGaA Zero Coupon 16 - 13.09.21	588 000	EUR	590 105	588 335	0,03
HOCHTIEF AG 0.50% 19 - 09.03.27	370 000	EUR	367 167	365 826	0,02
HOCHTIEF AG 1.75% 18 - 07.03.25	592 000	EUR	605 793	623 193	0,03
Infineon Technologies AG 0.75% 20 - 24.06.23	100 000	EUR	99 833	100 504	0,00
Infineon Technologies AG 1.125% 20 - 24.06.26	100 000	EUR	99 433	100 359	0,00
Infineon Technologies AG 1.50% 15 - 03.10.22	450 000	EUR	458 314	457 412	0,02
Infineon Technologies AG 1.625% 20 - 24.06.29	100 000	EUR	99 076	100 013	0,00
Infineon Technologies AG 2.00% 20 - 24.06.32	100 000	EUR	98 390	99 940	0,00
Knorr-Bremse AG 0.50% 16 - 12.08.21	476 000	EUR	479 754	476 328	0,02
Knorr-Bremse AG 1.125% 18 - 13.06.25	263 000	EUR	262 700	275 053	0,01
LANXESS AG 0.25% 16 - 10.07.21	383 000	EUR	383 373	383 218	0,02
LANXESS AG 1.00% 16 - 10.07.26	310 000	EUR	313 456	317 762	0,01
LANXESS AG 1.125% 18 - 16.05.25	420 000	EUR	422 897	432 243	0,02
LANXESS AG 2.625% 12 - 21.11.22	506 000	EUR	537 462	534 270	0,02
LEG Immobilien AG 0.875% 19 - 28.11.27	200 000	EUR	202 060	199 236	0,01
LEG Immobilien AG 1.25% 17 - 23.01.24	200 000	EUR	202 524	203 692	0,01
LEG Immobilien AG 1.625% 19 - 28.11.34	300 000	EUR	296 107	300 384	0,01
Merck Financial Services GmbH 0.005% 19 - 15.12.23	600 000	EUR	595 031	597 444	0,03
Merck Financial Services GmbH 0.125% 20 - 16.07.25	1 100 000	EUR	1 098 790	1 094 940	0,05
Merck Financial Services GmbH 0.375% 19 - 07.05.27	900 000	EUR	902 348	905 004	0,04
Merck Financial Services GmbH 0.50% 20 - 16.07.28	800 000	EUR	804 643	802 728	0,04
Merck Financial Services GmbH 0.875% 19 - 07.05.31	600 000	EUR	601 542	615 738	0,03
Merck Financial Services GmbH 1.375% 15 - 09.01.22	370 000	EUR	378 604	378 754	0,02
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	500 000	EUR	508 159	497 030	0,02
Merck KGaA FRN 14 - 12.12.74	1 000 000	EUR	1 023 672	1 004 420	0,05
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	900 000	EUR	944 293	938 646	0,04
Merck KGaA FRN 14 - 12.12.74	183 000	EUR	203 282	196 774	0,01
METRO AG 1.125% 18 - 03.06.23	400 000	EUR	393 974	392 160	0,02
Muenchener Hypothekenbank eG 0.50% 19 - 06.08.26	400 000	EUR	392 964	389 032	0,02
Muenchener Hypothekenbank eG 0.625% 15 - 02.10.22	200 000	EUR	202 535	200 270	0,01
Muenchener Hypothekenbank eG 0.875% 17 - 07.11.24	200 000	EUR	202 213	202 112	0,01
Muenchener Hypothekenbank eG 0.875% 18 - 09.12.25	100 000	EUR	104 127	101 411	0,00
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 18 - 26.05.49	1 200 000	EUR	1 316 609	1 368 516	0,06
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 12 - 26.05.42	1 100 000	EUR	1 234 756	1 208 592	0,05
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 18 - 07.05.25	600 000	EUR	625 938	629 886	0,03
Robert Bosch GmbH 1.75% 14 - 07.08.24	600 000	EUR	641 845	642 216	0,03
Santander Consumer Bank AG 0.25% 19 - 15.10.24	800 000	EUR	793 598	786 152	0,04
Santander Consumer Bank AG 0.75% 17 - 17.10.22	200 000	EUR	203 340	200 154	0,01
SAP SE Zero Coupon 20 - 17.05.23	1 000 000	EUR	1 000 949	1 000 960	0,05
SAP SE 0.125% 20 - 18.05.26	900 000	EUR	898 618	901 125	0,04
SAP SE 0.25% 18 - 03.10.22	1 000 000	EUR	1 004 175	1 004 880	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
SAP SE 0.375% 20 - 18.05.29	900 000	EUR	897 501	901 512	0,04
SAP SE 0.75% 18 - 12.10.24	1 400 000	EUR	1 428 196	1 443 540	0,06
SAP SE 1.00% 15 - 04.01.25	100 000	EUR	101 606	104 462	0,00
SAP SE 1.00% 18 - 13.03.26	700 000	EUR	729 047	735 399	0,03
SAP SE 1.125% 14 - 20.02.23	550 000	EUR	562 614	565 318	0,03
SAP SE 1.25% 18 - 03.10.28	800 000	EUR	825 568	861 280	0,04
SAP SE 1.375% 18 - 13.03.30	300 000	EUR	325 504	328 344	0,01
SAP SE 1.625% 18 - 03.10.31	1 000 000	EUR	1 082 585	1 120 880	0,05
SAP SE 1.75% 14 - 22.02.27	850 000	EUR	925 145	934 652	0,04
Schaeffler AG 1.125% 19 - 26.03.22	700 000	EUR	711 382	679 448	0,03
Schaeffler AG 1.875% 19 - 26.03.24	633 000	EUR	650 408	613 896	0,03
Schaeffler AG 1.875% 19 - 26.03.24	200 000	EUR	203 498	193 964	0,01
Schaeffler AG 2.875% 19 - 26.03.27	460 000	EUR	472 272	456 187	0,02
Talanx AG FRN 17 - 12.05.47	700 000	EUR	707 125	716 912	0,03
Talanx AG 2.50% 14 - 23.07.26	400 000	EUR	462 201	453 916	0,02
Talanx AG 2.50% 14 - 23.07.26	100 000	EUR	108 399	113 479	0,01
Talanx AG 3.125% 13 - 13.02.23	500 000	EUR	539 313	539 765	0,02
TLG Immobilien AG 0.375% 19 - 23.09.22	100 000	EUR	100 425	98 260	0,00
TLG Immobilien AG 1.50% 19 - 28.05.26	700 000	EUR	698 624	700 042	0,03
Vier Gas Transport GmbH 0.125% 19 - 09.10.29	300 000	EUR	286 026	290 073	0,01
Vier Gas Transport GmbH 0.50% 19 - 09.10.34	500 000	EUR	481 315	475 855	0,02
Vier Gas Transport GmbH 1.50% 18 - 25.09.28	200 000	EUR	207 116	219 264	0,01
Vier Gas Transport GmbH 2.875% 13 - 06.12.25	800 000	EUR	894 975	912 056	0,04
Vier Gas Transport GmbH 3.125% 13 - 07.10.23	1 023 000	EUR	1 121 869	1 122 384	0,05
Volkswagen Bank GmbH 0.375% 19 - 07.05.22	100 000	EUR	100 131	98 639	0,00
Volkswagen Bank GmbH 0.375% 19 - 07.05.22	300 000	EUR	302 060	295 917	0,01
Volkswagen Bank GmbH 0.625% 18 - 09.08.21	500 000	EUR	502 366	498 640	0,02
Volkswagen Bank GmbH 0.75% 17 - 15.06.23	750 000	EUR	749 498	741 000	0,03
Volkswagen Bank GmbH 1.25% 17 - 15.12.25	556 000	EUR	555 153	551 702	0,02
Volkswagen Bank GmbH 1.25% 18 - 06.10.24	900 000	EUR	902 667	900 207	0,04
Volkswagen Bank GmbH 1.25% 19 - 08.01.22	400 000	EUR	403 902	401 488	0,02
Volkswagen Bank GmbH 1.875% 19 - 31.01.24	1 000 000	EUR	1 027 207	1 023 730	0,05
Volkswagen Bank GmbH 2.50% 19 - 31.07.26	800 000	EUR	861 334	852 984	0,04
Volkswagen Financial Services AG 0.625% 19 - 04.01.22	906 000	EUR	903 936	900 111	0,04
Volkswagen Financial Services AG 0.75% 15 - 14.10.21	568 000	EUR	573 430	567 926	0,03
Volkswagen Financial Services AG 0.875% 18 - 04.12.23	613 000	EUR	619 058	608 501	0,03
Volkswagen Financial Services AG 1.375% 18 - 16.10.23	620 000	EUR	631 926	624 117	0,03
Volkswagen Financial Services AG 1.50% 19 - 10.01.24	510 000	EUR	513 525	514 728	0,02
Volkswagen Financial Services AG 1.50% 19 - 10.01.24	200 000	EUR	206 671	201 854	0,01
Volkswagen Financial Services AG 2.25% 18 - 16.10.26	740 000	EUR	755 961	778 532	0,04
Volkswagen Financial Services AG 2.25% 19 - 10.01.27	456 000	EUR	469 909	480 150	0,02
Volkswagen Financial Services AG 2.50% 20 - 04.06.23	494 000	EUR	491 924	511 409	0,02
Volkswagen Financial Services AG 3.00% 20 - 04.06.25	558 000	EUR	552 129	596 630	0,03
Volkswagen Financial Services AG 3.375% 20 - 04.06.28	808 000	EUR	812 999	902 964	0,04
Volkswagen Leasing GmbH 0.50% 19 - 20.06.22	761 000	EUR	763 670	752 637	0,03
Volkswagen Leasing GmbH 1.00% 18 - 16.02.23	998 000	EUR	999 148	995 784	0,04
Volkswagen Leasing GmbH 1.125% 17 - 04.04.24	760 000	EUR	752 304	756 694	0,03
Volkswagen Leasing GmbH 1.375% 17 - 20.01.25	889 000	EUR	906 284	889 773	0,04
Volkswagen Leasing GmbH 1.50% 19 - 19.06.26	498 000	EUR	513 705	500 286	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Volkswagen Leasing GmbH 1.625% 18 - 15.08.25	682 000	EUR	699 918	688 861	0,03
Volkswagen Leasing GmbH 2.125% 14 - 04.04.22	350 000	EUR	362 680	356 972	0,02
Volkswagen Leasing GmbH 2.375% 12 - 09.06.22	1 300 000	EUR	1 342 599	1 336 894	0,06
Volkswagen Leasing GmbH 2.625% 14 - 15.01.24	1 215 000	EUR	1 281 691	1 274 742	0,06
Wirecard AG 0.50% 19 - 09.11.24	500 000	EUR	476 705	95 630	0,00
WPP Finance Deutschland GmbH 1.625% 15 - 23.03.30	504 000	EUR	504 358	484 974	0,02
			178 030 352	177 973 096	7,95
Guernesey					
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1.25% 15 - 14.04.22	2 100 000	EUR	2 137 126	2 135 532	0,09
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2.875% 17 - 20.06.22	1 050 000	EUR	1 085 504	1 050 504	0,05
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3.00% 18 - 29.03.25	600 000	EUR	621 133	602 424	0,03
			3 843 763	3 788 460	0,17
Hongrie					
MOL Hungarian Oil & Gas PLC 2.625% 16 - 28.04.23	1 000 000	EUR	1 041 339	1 046 290	0,05
			1 041 339	1 046 290	0,05
Islande					
Arion Banki HF 1.00% 18 - 20.03.23	100 000	EUR	97 278	98 443	0,00
Arion Banki HF 1.625% 16 - 12.01.21	600 000	EUR	603 835	601 740	0,03
			701 113	700 183	0,03
Irlande					
Abbott Ireland Financing DAC 0.10% 19 - 19.11.24	300 000	EUR	299 148	298 374	0,01
Abbott Ireland Financing DAC 0.375% 19 - 19.11.27	600 000	EUR	594 371	599 214	0,03
Abbott Ireland Financing DAC 0.875% 18 - 27.09.23	1 425 000	EUR	1 455 897	1 458 003	0,07
Abbott Ireland Financing DAC 1.50% 18 - 27.09.26	800 000	EUR	840 301	855 224	0,04
AIB Group PLC 1.25% 19 - 28.05.24	550 000	EUR	541 208	549 895	0,02
AIB Group PLC 1.50% 18 - 29.03.23	300 000	EUR	291 223	303 294	0,01
AIB Group PLC 2.25% 18 - 07.03.25	550 000	EUR	563 887	577 940	0,03
Aon PLC 2.875% 14 - 14.05.26	400 000	EUR	443 458	444 864	0,02
Aquarius & Investments PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. FRN 13 - 10.02.43	897 000	EUR	983 480	978 250	0,04
Atlas Copco Finance DAC 0.125% 19 - 09.03.29	230 000	EUR	223 958	223 015	0,01
Bank of Ireland Group PLC FRN 19 - 07.08.24	100 000	EUR	99 879	98 180	0,00
Bank of Ireland Group PLC FRN 19 - 25.11.25	648 000	EUR	646 195	635 630	0,03
Bank of Ireland Group PLC 1.375% 18 - 29.08.23	1 169 000	EUR	1 154 779	1 169 935	0,05
Cloverie PLC for Swiss Reinsurance Co. Ltd. FRN 12 - 09.01.42	742 000	EUR	839 647	833 541	0,04
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 1.50% 18 - 15.12.28	390 000	EUR	410 349	417 203	0,02
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 1.75% 14 - 16.09.24	200 000	EUR	202 129	212 680	0,01
CRH Finance Dac 1.375% 16 - 18.10.28	500 000	EUR	521 567	526 440	0,02
CRH Finance Dac 3.125% 13 - 04.03.23	588 000	EUR	639 802	632 082	0,03
CRH SMW Finance DAC 1.25% 20 - 11.05.26	699 000	EUR	705 214	722 892	0,03
Dell Bank International Dac 0.625% 19 - 17.10.22	707 000	EUR	698 202	698 113	0,03
Eaton Capital Unlimited Co. 0.697% 19 - 14.05.25	407 000	EUR	408 773	407 916	0,02
Eaton Capital Unlimited Co. 0.75% 16 - 20.09.24	497 000	EUR	501 838	499 356	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Irlande (suite)					
Fresenius Finance Ireland PLC 0.875% 17 - 31.01.22	558 000	EUR	562 427	560 394	0,03
Fresenius Finance Ireland PLC 1.50% 17 - 30.01.24	716 000	EUR	739 610	740 280	0,03
Fresenius Finance Ireland PLC 2.125% 17 - 02.01.27	600 000	EUR	636 966	649 242	0,03
Fresenius Finance Ireland PLC 3.00% 17 - 30.01.32	306 000	EUR	343 557	358 917	0,02
GE Capital European Funding Unlimited Co. 0.80% 15 - 21.01.22	900 000	EUR	897 314	902 484	0,04
GE Capital European Funding Unlimited Co. 2.625% 13 - 15.03.23	1 014 000	EUR	1 057 007	1 060 938	0,05
GE Capital European Funding Unlimited Co. 4.625% 07 - 22.02.27	600 000	EUR	724 536	688 362	0,03
GE Capital European Funding Unlimited Co. 6.025% 08 - 03.01.38	592 000	EUR	832 575	771 648	0,03
Grenke Finance PLC 0.625% 19 - 01.09.25	188 000	EUR	188 942	177 652	0,01
Grenke Finance PLC 1.50% 18 - 10.05.23	244 000	EUR	238 234	242 516	0,01
Grenke Finance PLC 1.625% 19 - 04.05.24	150 000	EUR	151 450	148 812	0,01
Grenke Finance PLC 1.625% 19 - 04.05.24	150 000	EUR	145 840	148 812	0,01
Johnson Controls International PLC 1.00% 17 - 15.09.23	775 000	EUR	792 891	783 215	0,03
Johnson Controls International PLC 1.375% 16 - 25.02.25	150 000	EUR	153 134	153 561	0,01
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 0.625% 19 - 20.09.29	488 000	EUR	486 680	473 384	0,02
Kerry Group Financial Services Unltd. Co. 2.375% 15 - 09.10.25	930 000	EUR	1 008 648	1 025 111	0,05
Liberty Mutual Finance Europe DAC 1.75% 17 - 27.03.24	500 000	EUR	515 600	519 570	0,02
PartnerRe Ireland Finance DAC 1.25% 16 - 15.09.26	600 000	EUR	610 070	607 566	0,03
Roadster Finance DAC 1.625% 17 - 12.09.24	700 000	EUR	687 159	694 050	0,03
Roadster Finance DAC 2.375% 17 - 12.08.27	100 000	EUR	101 848	97 738	0,00
Ryanair DAC 1.125% 15 - 03.10.23	500 000	EUR	496 156	467 685	0,02
Ryanair DAC 1.125% 17 - 15.08.23	809 000	EUR	828 346	752 200	0,03
Ryanair DAC 1.875% 14 - 17.06.21	200 000	EUR	203 272	194 220	0,01
Transmission Finance DAC 1.50% 16 - 24.05.23	550 000	EUR	563 795	568 018	0,03
Willow No 2 Ireland PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 3.375% 12 - 27.06.22	1 100 000	EUR	1 166 556	1 168 519	0,05
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 1.625% 19 - 17.06.39	440 000	EUR	477 946	488 677	0,02
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. FRN 20 - 17.09.50	500 000	EUR	498 497	499 450	0,02
			28 174 361	28 085 062	1,25
Italie					
2i Rete Gas SpA 1.608% 17 - 31.10.27	600 000	EUR	601 816	631 692	0,03
2i Rete Gas SpA 1.75% 17 - 28.08.26	200 000	EUR	206 539	210 990	0,01
2i Rete Gas SpA 2.195% 18 - 09.11.25	570 000	EUR	598 360	614 922	0,03
2i Rete Gas SpA 3.00% 14 - 16.07.24	700 000	EUR	764 845	773 759	0,03
Aeroporti di Roma SpA 1.625% 17 - 06.08.27	300 000	EUR	289 938	285 918	0,01
AMCO - Asset Management Co. SpA 1.375% 19 - 27.01.25	569 000	EUR	560 726	560 363	0,03
Assicurazioni Generali SpA 2.124% 19 - 10.01.30	650 000	EUR	649 840	625 573	0,03
Assicurazioni Generali SpA 3.875% 19 - 29.01.29	600 000	EUR	655 727	648 492	0,03
Assicurazioni Generali SpA 4.125% 14 - 05.04.26	1 200 000	EUR	1 321 263	1 312 428	0,06

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Assicurazioni Generali SpA FRN 16 - 06.08.48	700 000	EUR	762 012	780 731	0,04
Assicurazioni Generali SpA 5.125% 09 - 16.09.24	1 187 000	EUR	1 406 626	1 417 325	0,06
Assicurazioni Generali SpA FRN 15 - 27.10.47	1 100 000	EUR	1 274 087	1 254 385	0,06
Assicurazioni Generali SpA FRN 12 - 12.12.42	700 000	EUR	822 612	808 248	0,04
Assicurazioni Generali SpA FRN 12 - 07.10.42	500 000	EUR	623 253	584 960	0,03
ASTM SpA 1.625% 18 - 02.08.28	500 000	EUR	483 428	470 190	0,02
ASTM SpA 3.375% 14 - 13.02.24	379 000	EUR	410 311	397 434	0,02
Azimut Holding SpA 1.625% 19 - 12.12.24	500 000	EUR	507 273	475 390	0,02
Azimut Holding SpA 2.00% 17 - 28.03.22	326 000	EUR	332 927	326 610	0,01
Buzzi Unicem SpA 2.125% 16 - 28.04.23	271 000	EUR	282 426	279 840	0,01
Enel SpA FRN 18 - 24.11.78	1 000 000	EUR	997 251	1 000 280	0,04
Enel SpA FRN 18 - 24.11.81	611 000	EUR	627 949	627 815	0,03
Enel SpA FRN 19 - 24.05.80	906 000	EUR	944 067	937 982	0,04
Enel SpA 5.25% 04 - 20.05.24	620 000	EUR	722 002	742 233	0,03
Enel SpA 5.625% 07 - 21.06.27	800 000	EUR	1 052 418	1 083 176	0,05
Eni SpA 0.625% 16 - 19.09.24	556 000	EUR	561 156	559 581	0,03
Eni SpA 0.625% 20 - 23.01.30	780 000	EUR	788 871	760 921	0,03
Eni SpA 0.75% 16 - 17.05.22	800 000	EUR	810 121	806 112	0,04
Eni SpA 1.00% 17 - 14.03.25	500 000	EUR	502 097	511 890	0,02
Eni SpA 1.00% 19 - 10.11.34	811 000	EUR	801 790	803 936	0,04
Eni SpA 1.125% 16 - 19.09.28	589 000	EUR	600 424	606 163	0,03
Eni SpA 1.25% 20 - 18.05.26	1 114 000	EUR	1 131 901	1 153 981	0,05
Eni SpA 1.25% 20 - 18.05.26	100 000	EUR	101 844	103 589	0,00
Eni SpA 1.50% 15 - 02.02.26	1 031 000	EUR	1 072 333	1 081 746	0,05
Eni SpA 1.50% 17 - 17.01.27	811 000	EUR	847 233	854 656	0,04
Eni SpA 1.625% 16 - 17.05.28	706 000	EUR	748 228	754 340	0,03
Eni SpA 1.75% 15 - 18.01.24	511 000	EUR	529 408	536 959	0,02
Eni SpA 1.75% 15 - 18.01.24	700 000	EUR	729 544	735 560	0,03
Eni SpA 2.00% 20 - 18.05.31	1 014 000	EUR	1 075 402	1 119 446	0,05
Eni SpA 2.625% 13 - 22.11.21	300 000	EUR	311 818	309 873	0,01
Eni SpA 3.25% 13 - 07.10.23	1 066 000	EUR	1 154 400	1 162 420	0,05
Eni SpA 3.625% 14 - 29.01.29	814 000	EUR	983 517	1 000 259	0,04
Eni SpA 3.75% 13 - 09.12.25	908 000	EUR	1 042 228	1 059 945	0,05
ERG SpA 1.875% 19 - 04.11.25	399 000	EUR	409 733	415 495	0,02
FCA Bank SpA 0.25% 20 - 28.02.23	978 000	EUR	955 851	938 264	0,04
FCA Bank SpA 0.50% 19 - 13.09.24	500 000	EUR	483 176	470 715	0,02
FCA Bank SpA 0.625% 19 - 24.11.22	1 108 000	EUR	1 098 408	1 085 762	0,05
FCA Bank SpA 1.00% 17 - 15.11.21	500 000	EUR	504 002	497 405	0,02
FCA Bank SpA 1.00% 18 - 21.02.22	589 000	EUR	589 081	585 802	0,03
FCA Bank SpA 1.25% 19 - 21.06.22	898 000	EUR	900 666	894 112	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 19 - 12.04.24	568 000	EUR	576 239	560 428	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 0.875% 17 - 27.06.22	400 000	EUR	403 737	400 424	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 07.04.24	1 618 000	EUR	1 608 878	1 609 360	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 19.11.26	1 690 000	EUR	1 655 862	1 652 634	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 1.125% 15 - 03.04.22	1 300 000	EUR	1 307 879	1 307 891	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 1.375% 17 - 18.01.24	1 300 000	EUR	1 291 401	1 311 180	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 18 - 20.03.28	700 000	EUR	681 088	709 583	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 19 - 07.04.29	900 000	EUR	914 984	903 042	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 2.00% 14 - 18.06.21	400 000	EUR	406 799	406 240	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 18 - 30.08.23	900 000	EUR	938 227	933 894	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 20 - 26.05.25	1 318 000	EUR	1 342 510	1 370 456	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 3.50% 14 - 17.01.22	800 000	EUR	838 324	835 512	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 13 - 30.10.23	757 000	EUR	849 119	830 172	0,04
Iren SpA 0.875% 16 - 11.04.24	700 000	EUR	699 810	713 349	0,03
Iren SpA 0.875% 19 - 14.10.29	370 000	EUR	373 028	373 241	0,02
Iren SpA 1.00% 20 - 07.01.30	500 000	EUR	490 720	492 700	0,02
Iren SpA 1.50% 17 - 24.10.27	250 000	EUR	255 013	265 920	0,01
Iren SpA 1.95% 18 - 19.09.25	1 000 000	EUR	1 037 533	1 074 030	0,05
Iren SpA 2.75% 15 - 11.02.22	100 000	EUR	104 544	105 322	0,01
Italgas SpA 0.25% 20 - 24.06.25	220 000	EUR	218 258	218 401	0,01
Italgas SpA 0.875% 19 - 24.04.30	582 000	EUR	591 558	588 105	0,03
Italgas SpA 1.00% 19 - 12.11.31	390 000	EUR	393 557	396 727	0,02
Italgas SpA 1.125% 17 - 14.03.24	868 000	EUR	885 178	895 672	0,04
Italgas SpA 1.625% 17 - 19.01.27	598 000	EUR	624 005	640 099	0,03
Italgas SpA 1.625% 17 - 18.01.29	500 000	EUR	512 685	538 635	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.625% 17 - 27.09.22	800 000	EUR	795 584	797 072	0,04
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.75% 20 - 15.07.27	568 000	EUR	517 009	537 902	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.875% 19 - 15.01.26	474 000	EUR	460 747	458 884	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.875% 19 - 15.01.26	150 000	EUR	152 494	145 216	0,01
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.125% 19 - 15.07.25	100 000	EUR	101 465	98 714	0,00
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.125% 20 - 23.04.25	340 000	EUR	326 911	326 009	0,01
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.625% 19 - 01.07.25	600 000	EUR	611 394	605 886	0,03
Snam SpA Zero Coupon 19 - 05.12.24	899 000	EUR	889 920	888 922	0,04
Snam SpA 0.75% 20 - 17.06.30	500 000	EUR	499 283	504 810	0,02
Snam SpA 0.875% 16 - 25.10.26	800 000	EUR	793 637	822 680	0,04
Snam SpA 1.00% 18 - 18.09.23	1 100 000	EUR	1 119 652	1 123 716	0,05
Snam SpA 1.00% 19 - 09.12.34	571 000	EUR	568 510	575 557	0,03
Snam SpA 1.25% 17 - 25.01.25	300 000	EUR	311 427	311 985	0,01
Snam SpA 1.25% 19 - 28.08.25	900 000	EUR	927 721	936 846	0,04
Snam SpA 1.375% 17 - 25.10.27	500 000	EUR	521 234	532 635	0,02
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 0.125% 19 - 25.07.25	800 000	EUR	786 947	791 656	0,04
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 0.875% 15 - 02.02.22	897 000	EUR	903 707	904 849	0,04
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 16 - 10.11.28	550 000	EUR	563 002	568 040	0,03
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 18 - 23.07.23	1 000 000	EUR	1 023 520	1 021 130	0,05
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 19 - 04.10.26	200 000	EUR	202 693	206 044	0,01
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.375% 17 - 26.07.27	652 000	EUR	657 892	692 372	0,03
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 4.90% 04 - 28.10.24	1 128 000	EUR	1 364 296	1 349 607	0,06
UniCredit SpA 0.50% 19 - 04.09.25	1 100 000	EUR	1 085 838	1 060 290	0,05
UniCredit SpA 1.00% 18 - 18.01.23	1 471 000	EUR	1 446 584	1 452 745	0,07
UniCredit SpA FRN 20 - 20.01.26	1 101 000	EUR	1 080 092	1 055 694	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
UniCredit SpA FRN 19 - 25.06.25	1 000 000	EUR	1 016 857	999 710	0,04
UniCredit SpA FRN 20 - 16.06.26	290 000	EUR	288 741	289 292	0,01
UniCredit SpA FRN 19 - 07.03.25	750 000	EUR	737 256	735 495	0,03
UniCredit SpA 1.80% 20 - 20.01.30	780 000	EUR	768 863	751 257	0,03
UniCredit SpA 2.00% 16 - 03.04.23	700 000	EUR	716 480	721 847	0,03
UniCredit SpA 2.125% 16 - 24.10.26	940 000	EUR	990 392	986 521	0,04
Unione di Banche Italiane SpA 0.75% 17 - 17.10.22	1 135 000	EUR	1 111 842	1 131 402	0,05
Unione di Banche Italiane SpA 1.00% 19 - 22.07.22	1 000 000	EUR	1 000 117	997 200	0,04
Unione di Banche Italiane SpA 1.50% 19 - 04.10.24	100 000	EUR	99 321	101 380	0,00
			79 073 292	79 276 050	3,54
Japon					
Asahi Group Holdings Ltd. 0.321% 17 - 19.09.21	500 000	EUR	501 235	497 795	0,02
Asahi Group Holdings Ltd. 1.151% 17 - 19.09.25	378 000	EUR	379 327	384 740	0,02
Mercedes-Benz Finance Co. Ltd. Zero Coupon 19 - 21.08.22	400 000	EUR	400 017	395 200	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.339% 19 - 19.07.24	1 000 000	EUR	990 829	992 580	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.68% 18 - 26.01.23	299 000	EUR	304 272	301 909	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.848% 19 - 19.07.29	200 000	EUR	198 953	199 664	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.872% 17 - 09.07.24	559 000	EUR	557 049	566 558	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.978% 20 - 06.09.24	200 000	EUR	200 000	203 860	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.98% 18 - 10.09.23	400 000	EUR	398 437	407 660	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 0.118% 19 - 09.06.24	750 000	EUR	739 539	733 462	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.402% 19 - 09.06.29	400 000	EUR	381 178	381 304	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 0.523% 19 - 06.10.24	911 000	EUR	907 050	908 112	0,04
Mizuho Financial Group Inc. 0.797% 20 - 15.04.30	768 000	EUR	732 719	751 196	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.956% 17 - 16.10.24	102 000	EUR	104 502	103 492	0,00
Mizuho Financial Group Inc. 1.02% 18 - 10.11.23	407 000	EUR	418 911	413 260	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 1.598% 18 - 04.10.28	407 000	EUR	418 133	429 877	0,02
MUFG Bank Ltd. 0.875% 15 - 03.11.22	50 000	EUR	50 490	50 683	0,00
MUFG Bank Ltd. 0.875% 15 - 03.11.22	600 000	EUR	607 513	608 190	0,03
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 1.00% 15 - 19.01.22	852 000	EUR	863 451	863 442	0,04
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2.75% 13 - 24.07.23	200 000	EUR	213 584	215 896	0,01
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.465% 19 - 30.05.24	680 000	EUR	683 572	679 748	0,03
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.606% 17 - 18.01.22	500 000	EUR	499 468	501 735	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.632% 19 - 23.10.29	1 050 000	EUR	1 028 759	1 021 051	0,05
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.819% 18 - 23.07.23	700 000	EUR	713 569	710 752	0,03
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.934% 17 - 10.11.24	279 000	EUR	278 636	284 480	0,01
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.413% 17 - 14.06.27	420 000	EUR	433 761	444 608	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.546% 16 - 15.06.26	1 036 000	EUR	1 074 685	1 108 012	0,05
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0.75% 20 - 07.09.27	510 000	EUR	509 898	512 489	0,02
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.00% 20 - 07.09.29	620 000	EUR	618 779	621 513	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.125% 18 - 21.11.22	1 449 000	EUR	1 470 211	1 474 691	0,07
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.375% 20 - 07.09.32	530 000	EUR	529 417	533 312	0,02
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.00% 20 - 07.09.40	500 000	EUR	496 500	499 890	0,02
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.25% 18 - 21.11.26	1 196 000	EUR	1 272 949	1 310 015	0,06
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.00% 18 - 21.11.30	1 451 000	EUR	1 621 425	1 703 547	0,08
			20 598 818	20 814 723	0,93
Jersey					
Aptiv PLC 1.50% 15 - 03.10.25	1 014 000	EUR	1 038 955	1 008 251	0,05
Aptiv PLC 1.60% 16 - 15.09.28	200 000	EUR	187 606	193 170	0,01
Atrium European Real Estate Ltd. 3.00% 18 - 09.11.25	500 000	EUR	509 945	482 740	0,02
Glencore Finance Europe Ltd. 0.625% 19 - 09.11.24	559 000	EUR	555 492	537 495	0,02
Glencore Finance Europe Ltd. 1.50% 19 - 15.10.26	560 000	EUR	567 291	549 024	0,02
Glencore Finance Europe Ltd. 1.625% 14 - 18.01.22	288 000	EUR	291 755	288 927	0,01
Glencore Finance Europe Ltd. 1.75% 15 - 17.03.25	680 000	EUR	685 556	682 740	0,03
Glencore Finance Europe Ltd. 1.875% 16 - 13.09.23	1 066 000	EUR	1 076 348	1 078 909	0,05
Glencore Finance Europe Ltd. 3.75% 14 - 04.01.26	550 000	EUR	610 700	609 307	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.50% 15 - 02.11.30	574 000	EUR	599 828	575 538	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 14 - 23.05.22	687 000	EUR	701 878	698 384	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 17 - 07.12.32	500 000	EUR	490 628	508 620	0,02
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 19 - 14.03.34	650 000	EUR	675 676	657 696	0,03
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3.25% 15 - 11.12.25	500 000	EUR	506 057	473 745	0,02
			8 497 715	8 344 546	0,37
Corée					
LG Chem Ltd. 0.50% 19 - 15.04.23	146 000	EUR	146 889	143 698	0,01
POSCO 0.50% 20 - 17.01.24	499 000	EUR	487 556	481 555	0,02
Shinhan Bank Co. Ltd. 0.25% 19 - 16.10.24	599 000	EUR	588 723	578 316	0,02
			1 223 168	1 203 569	0,05
Luxembourg					
Alpha Trains Finance SA 2.064% 15 - 30.06.25	200 000	EUR	207 892	209 928	0,01
Aroundtown SA 0.625% 19 - 07.09.25	900 000	EUR	903 373	879 525	0,04
Aroundtown SA 1.00% 17 - 01.07.25	400 000	EUR	406 355	398 644	0,02
Aroundtown SA 1.45% 19 - 07.09.28	500 000	EUR	498 565	499 130	0,02
Aroundtown SA 1.50% 16 - 15.07.24	400 000	EUR	410 464	406 688	0,02
Aroundtown SA 1.625% 18 - 31.01.28	800 000	EUR	799 133	815 872	0,04
Aroundtown SA 1.875% 17 - 19.01.26	400 000	EUR	408 241	415 468	0,02
Aroundtown SA 2.00% 18 - 11.02.26	500 000	EUR	503 898	524 615	0,02
Aroundtown SA FRN 18 - 31.12.99	500 000	EUR	478 339	462 355	0,02
Aroundtown SA FRN 19 - 31.12.99	300 000	EUR	289 280	282 765	0,01
Banque Internationale a Luxembourg SA 1.50% 18 - 28.09.23	100 000	EUR	100 072	99 561	0,00
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.632% 19 - 06.04.23	700 000	EUR	699 755	695 485	0,03
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.632% 19 - 06.04.23	200 000	EUR	199 744	198 710	0,01
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 19 - 06.04.26	700 000	EUR	702 373	702 457	0,03
Bevco Lux Sarl 1.75% 18 - 02.09.23	528 000	EUR	543 201	530 529	0,02
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 0.50% 19 - 09.12.23	410 000	EUR	399 900	404 957	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Luxembourg (suite)					
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 1.40% 18 - 07.06.22	300 000	EUR	306 762	303 171	0,01
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 1.75% 19 - 03.12.29	650 000	EUR	642 183	642 909	0,03
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 2.00% 19 - 15.02.24	600 000	EUR	618 980	617 178	0,03
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 2.20% 18 - 24.07.25	600 000	EUR	624 639	624 690	0,03
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 0.375% 19 - 17.10.23	1 721 000	EUR	1 711 447	1 705 735	0,08
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 0.75% 19 - 17.04.26	560 000	EUR	558 736	551 118	0,02
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 0.75% 19 - 17.04.26	100 000	EUR	99 810	98 414	0,00
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1.125% 19 - 17.10.28	1 335 000	EUR	1 328 996	1 318 499	0,06
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1.50% 19 - 17.10.31	650 000	EUR	647 337	644 806	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 1.375% 17 - 23.05.22	600 000	EUR	612 039	602 454	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 1.625% 19 - 07.03.29	383 000	EUR	387 567	363 425	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 17 - 09.12.25	450 000	EUR	451 571	454 482	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 19 - 25.03.27	700 000	EUR	715 006	685 608	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 1.875% 18 - 19.01.26	700 000	EUR	681 863	695 821	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 2.875% 14 - 27.09.21	475 000	EUR	490 767	485 251	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA 2.875% 16 - 17.05.23	315 000	EUR	335 827	331 386	0,01
CPI Property Group SA 1.45% 18 - 14.04.22	400 000	EUR	405 981	397 892	0,02
CPI Property Group SA 1.625% 19 - 23.04.27	600 000	EUR	593 503	569 952	0,03
CPI Property Group SA 2.125% 17 - 10.04.24	300 000	EUR	296 694	301 032	0,01
CPI Property Group SA 2.75% 20 - 05.12.26	611 000	EUR	603 977	625 285	0,03
DH Europe Finance II Sarl 0.20% 19 - 18.03.26	310 000	EUR	308 544	304 997	0,01
DH Europe Finance II Sarl 0.20% 19 - 18.03.26	500 000	EUR	498 957	491 930	0,02
DH Europe Finance II Sarl 0.45% 19 - 18.03.28	130 000	EUR	129 706	127 076	0,01
DH Europe Finance II Sarl 0.45% 19 - 18.03.28	1 000 000	EUR	1 000 683	977 510	0,04
DH Europe Finance II Sarl 0.75% 19 - 18.09.31	1 800 000	EUR	1 790 600	1 735 506	0,08
DH Europe Finance II Sarl 1.35% 19 - 18.09.39	170 000	EUR	169 120	162 127	0,01
DH Europe Finance II Sarl 1.35% 19 - 18.09.39	1 100 000	EUR	1 060 470	1 049 059	0,05
DH Europe Finance II Sarl Zero Coupon 19 - 18.09.49	150 000	EUR	148 721	144 200	0,01
DH Europe Finance II Sarl 1.80% 19 - 18.09.49	500 000	EUR	510 614	480 665	0,02
DH Europe Finance Sarl 1.20% 17 - 30.06.27	471 000	EUR	492 190	487 711	0,02
DH Europe Finance Sarl 1.70% 15 - 01.04.22	862 000	EUR	883 239	879 093	0,04
DH Europe Finance Sarl 2.50% 15 - 07.08.25	1 013 000	EUR	1 113 978	1 118 737	0,05
Euroclear Investments SA 1.125% 16 - 12.07.26	500 000	EUR	512 447	527 505	0,02
Euroclear Investments SA 1.50% 18 - 04.11.30	200 000	EUR	216 891	218 036	0,01
Euroclear Investments SA FRN 18 - 04.11.48	300 000	EUR	308 706	318 744	0,01
GELF Bond Issuer I SA 0.875% 16 - 20.10.22	200 000	EUR	198 622	199 710	0,01
GELF Bond Issuer I SA 1.125% 19 - 18.07.29	500 000	EUR	489 669	479 075	0,02
GELF Bond Issuer I SA 1.625% 16 - 20.10.26	500 000	EUR	511 375	519 430	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Luxembourg (suite)					
Grand City Properties SA 1.375% 17 - 08.03.26	800 000	EUR	811 244	823 576	0,04
Grand City Properties SA 1.50% 15 - 17.04.25	300 000	EUR	311 697	310 083	0,01
Grand City Properties SA 1.50% 18 - 22.02.27	500 000	EUR	492 874	517 615	0,02
Grand City Properties SA 1.70% 20 - 04.09.24	900 000	EUR	914 626	935 226	0,04
Grand City Properties SA FRN 18 - 31.12.99	300 000	EUR	297 283	294 819	0,01
Grand City Properties SA FRN 15 - 29.12.49	200 000	EUR	212 350	203 834	0,01
Hannover Finance Luxembourg SA FRN 12 - 30.06.43	500 000	EUR	565 088	558 225	0,03
Harman Finance International SCA 2.00% 15 - 27.05.22	100 000	EUR	102 772	101 284	0,00
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 0.50% 18 - 08.09.22	600 000	EUR	594 234	595 212	0,03
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.125% 19 - 12.01.27	850 000	EUR	867 781	839 638	0,04
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.50% 17 - 14.06.27	480 000	EUR	486 947	486 538	0,02
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.625% 17 - 04.07.26	1 400 000	EUR	1 426 195	1 432 746	0,06
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.75% 18 - 24.04.28	588 000	EUR	598 882	600 677	0,03
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 2.50% 20 - 10.09.24	618 000	EUR	640 968	655 642	0,03
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 3.25% 13 - 21.10.21	300 000	EUR	307 720	309 933	0,01
Helvetia Europe SA FRN 20 - 30.09.41	150 000	EUR	148 626	151 169	0,01
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 19 - 29.11.26	567 000	EUR	552 891	558 155	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 1.375% 16 - 26.05.23	865 000	EUR	884 628	885 025	0,04
Holcim Finance Luxembourg SA 1.75% 17 - 29.08.29	600 000	EUR	603 292	635 364	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 2.25% 16 - 26.05.28	900 000	EUR	978 470	992 781	0,04
Holcim Finance Luxembourg SA 2.375% 20 - 04.09.25	899 000	EUR	940 015	966 524	0,04
Holcim Finance Luxembourg SA 3.00% 14 - 22.01.24	255 000	EUR	269 701	276 364	0,01
John Deere Cash Management SA 0.50% 17 - 15.09.23	200 000	EUR	200 112	201 616	0,01
John Deere Cash Management SA 1.375% 20 - 04.02.24	706 000	EUR	709 250	733 110	0,03
John Deere Cash Management SA 1.65% 19 - 13.06.39	660 000	EUR	700 781	705 045	0,03
John Deere Cash Management SA 1.85% 20 - 04.02.28	555 000	EUR	562 158	600 943	0,03
John Deere Cash Management SA 2.20% 20 - 04.02.32	555 000	EUR	566 592	629 242	0,03
Logicor Financing Sarl 0.75% 19 - 15.07.24	980 000	EUR	966 122	964 565	0,04
Logicor Financing Sarl 1.50% 18 - 14.11.22	900 000	EUR	902 502	910 062	0,04
Logicor Financing Sarl 1.50% 18 - 14.11.22	141 000	EUR	145 487	142 576	0,01
Logicor Financing Sarl 1.625% 19 - 15.07.27	850 000	EUR	861 806	855 508	0,04
Logicor Financing Sarl 2.25% 18 - 13.05.25	500 000	EUR	496 969	521 195	0,02
Logicor Financing Sarl 3.25% 18 - 13.11.28	506 000	EUR	560 766	551 930	0,02
Medtronic Global Holdings SCA Zero Coupon 19 - 12.02.22	600 000	EUR	601 322	596 232	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 0.25% 19 - 07.02.25	900 000	EUR	902 973	895 581	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 19 - 03.07.23	930 000	EUR	937 041	931 879	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 19 - 03.07.23	600 000	EUR	604 348	601 212	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 19 - 07.02.31	1 012 000	EUR	1 034 738	1 039 435	0,05
Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 19 - 03.07.27	1 518 000	EUR	1 574 300	1 585 445	0,07
Medtronic Global Holdings SCA 1.50% 19 - 07.02.39	880 000	EUR	897 289	880 519	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Luxembourg (suite)					
Medtronic Global Holdings SCA 1.625% 19 - 03.07.31	766 000	EUR	828 978	835 338	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 1.75% 19 - 07.02.49	800 000	EUR	792 726	781 056	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 1.75% 19 - 07.02.49	100 000	EUR	101 630	97 632	0,00
Medtronic Global Holdings SCA 2.25% 19 - 03.07.39	966 000	EUR	1 080 407	1 087 301	0,05
Michelin Luxembourg SCS 1.125% 15 - 28.05.22	100 000	EUR	102 307	101 702	0,00
Michelin Luxembourg SCS 1.75% 15 - 28.05.27	500 000	EUR	535 102	547 310	0,02
Nestle Finance International Ltd. Zero Coupon 20 - 11.12.24	1 129 000	EUR	1 126 614	1 129 813	0,05
Nestle Finance International Ltd. 0.125% 20 - 11.12.27	1 092 000	EUR	1 086 967	1 088 648	0,05
Nestle Finance International Ltd. 0.375% 17 - 18.01.24	459 000	EUR	466 262	465 899	0,02
Nestle Finance International Ltd. 0.375% 20 - 05.12.32	914 000	EUR	900 196	902 273	0,04
Nestle Finance International Ltd. 0.75% 14 - 11.08.21	200 000	EUR	202 167	202 056	0,01
Nestle Finance International Ltd. 0.75% 15 - 16.05.23	116 000	EUR	118 070	118 580	0,01
Nestle Finance International Ltd. 1.125% 20 - 04.01.26	1 358 000	EUR	1 417 201	1 435 094	0,06
Nestle Finance International Ltd. 1.25% 17 - 11.02.29	374 000	EUR	414 425	411 482	0,02
Nestle Finance International Ltd. 1.25% 17 - 11.02.29	100 000	EUR	106 238	110 022	0,01
Nestle Finance International Ltd. 1.50% 20 - 04.01.30	986 000	EUR	1 062 595	1 090 279	0,05
Nestle Finance International Ltd. 1.75% 12 - 09.12.22	1 079 000	EUR	1 123 530	1 121 534	0,05
Nestle Finance International Ltd. 1.75% 17 - 11.02.37	600 000	EUR	679 288	713 424	0,03
Novartis Finance SA 0.125% 16 - 20.09.23	1 050 000	EUR	1 058 874	1 058 778	0,05
Novartis Finance SA 0.50% 18 - 14.08.23	1 298 000	EUR	1 320 455	1 320 533	0,06
Novartis Finance SA 0.625% 16 - 20.09.28	200 000	EUR	199 259	208 292	0,01
Novartis Finance SA 0.75% 14 - 11.09.21	300 000	EUR	303 922	303 555	0,01
Novartis Finance SA 1.125% 17 - 30.09.27	1 000 000	EUR	1 055 550	1 077 180	0,05
Novartis Finance SA 1.375% 18 - 14.08.30	568 000	EUR	589 724	625 919	0,03
Novartis Finance SA 1.625% 14 - 11.09.26	759 000	EUR	831 738	836 357	0,04
Novartis Finance SA 1.70% 18 - 14.08.38	609 000	EUR	673 161	713 571	0,03
Prologis International Funding II SA 0.875% 19 - 07.09.29	366 000	EUR	365 360	368 170	0,02
Prologis International Funding II SA 1.75% 18 - 15.03.28	250 000	EUR	249 508	270 585	0,01
Prologis International Funding II SA 1.876% 15 - 17.04.25	125 000	EUR	129 269	132 908	0,01
Prologis International Funding II SA 2.375% 18 - 14.11.30	250 000	EUR	273 895	283 505	0,01
Prologis International Funding II SA 2.875% 14 - 04.04.22	406 000	EUR	426 716	422 894	0,02
Richemont International Holding SA 0.75% 20 - 26.05.28	907 000	EUR	922 213	932 650	0,04
Richemont International Holding SA 1.00% 18 - 26.03.26	1 490 000	EUR	1 532 999	1 558 734	0,07
Richemont International Holding SA 1.125% 20 - 26.05.32	692 000	EUR	714 430	727 901	0,03
Richemont International Holding SA 1.50% 18 - 26.03.30	981 000	EUR	1 035 152	1 072 979	0,05
Richemont International Holding SA 1.625% 20 - 26.05.40	629 000	EUR	642 602	646 631	0,03
Richemont International Holding SA 2.00% 18 - 26.03.38	1 057 000	EUR	1 166 814	1 193 036	0,05
SELP Finance Sarl 1.25% 16 - 25.10.23	379 000	EUR	386 386	381 990	0,02
SELP Finance Sarl 1.50% 17 - 20.11.25	650 000	EUR	658 574	649 025	0,03
SELP Finance Sarl 1.50% 19 - 20.12.26	300 000	EUR	299 151	294 180	0,01
SES SA 0.875% 19 - 11.04.27	300 000	EUR	285 913	278 421	0,01
SES SA 1.625% 18 - 22.03.26	665 000	EUR	673 284	663 756	0,03
SES SA 2.00% 20 - 07.02.28	510 000	EUR	507 170	508 649	0,02
Simon International Finance SCA 1.25% 16 - 13.05.25	399 000	EUR	406 171	395 166	0,02
Simon International Finance SCA 1.375% 15 - 18.11.22	1 348 000	EUR	1 358 355	1 350 588	0,06
Swiss Re Finance Luxembourg SA FRN 19 - 30.04.50	700 000	EUR	756 211	734 916	0,03
Talanx Finanz Luxembourg SA FRN 12 - 15.06.42	500 000	EUR	586 235	570 735	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Luxembourg (suite)					
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 20 - 14.02.25	392 000	EUR	390 385	375 908	0,02
Tyco Electronics Group SA 1.10% 15 - 03.01.23	800 000	EUR	817 714	814 472	0,04
Whirlpool EMEA Finance Sarl 0.50% 20 - 20.02.28	547 000	EUR	512 606	508 628	0,02
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.10% 17 - 11.09.27	180 000	EUR	178 562	176 546	0,01
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.10% 17 - 11.09.27	380 000	EUR	386 798	372 708	0,02
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.25% 16 - 11.02.26	600 000	EUR	608 598	599 946	0,03
			90 690 099	90 912 688	4,06
Mexique					
America Movil SAB de CV 0.75% 19 - 26.06.27	800 000	EUR	817 976	785 776	0,03
America Movil SAB de CV 1.50% 16 - 03.10.24	711 000	EUR	728 426	729 351	0,03
America Movil SAB de CV 2.125% 16 - 03.10.28	542 000	EUR	578 329	585 962	0,03
America Movil SAB de CV 3.00% 12 - 07.12.21	370 000	EUR	381 397	378 432	0,02
America Movil SAB de CV 3.259% 13 - 22.07.23	730 000	EUR	790 462	786 268	0,03
America Movil SAB de CV 4.75% 10 - 28.06.22	725 000	EUR	792 162	781 057	0,03
America Movil SAB de CV FRN 13 - 09.06.73	500 000	EUR	560 904	562 680	0,03
Fomento Economico Mexicano SAB de CV 1.75% 16 - 20.03.23	585 000	EUR	605 189	601 193	0,03
Sigma Alimentos SA de CV 2.625% 17 - 02.07.24	578 000	EUR	591 632	589 797	0,03
			5 846 477	5 800 516	0,26
Pays-Bas					
ABB Finance BV 0.625% 16 - 05.03.23	300 000	EUR	303 723	303 804	0,01
ABB Finance BV 0.75% 17 - 16.05.24	388 000	EUR	398 994	396 908	0,02
ABN AMRO Bank NV 0.25% 18 - 12.03.21	1 300 000	EUR	1 306 153	1 304 004	0,06
ABN AMRO Bank NV 0.50% 18 - 17.07.23	1 350 000	EUR	1 361 217	1 369 764	0,06
ABN AMRO Bank NV 0.50% 19 - 15.04.26	467 000	EUR	468 883	477 073	0,02
ABN AMRO Bank NV 0.60% 20 - 15.01.27	1 500 000	EUR	1 490 039	1 478 910	0,07
ABN AMRO Bank NV 0.625% 16 - 31.05.22	500 000	EUR	502 525	506 330	0,02
ABN AMRO Bank NV 0.875% 18 - 22.04.25	700 000	EUR	723 244	726 600	0,03
ABN AMRO Bank NV 0.875% 19 - 15.01.24	1 500 000	EUR	1 526 616	1 543 515	0,07
ABN AMRO Bank NV 1.00% 15 - 16.04.25	1 039 000	EUR	1 076 152	1 088 311	0,05
ABN AMRO Bank NV 1.25% 20 - 28.05.25	1 300 000	EUR	1 307 658	1 329 796	0,06
ABN AMRO Bank NV 2.50% 13 - 29.11.23	850 000	EUR	922 177	921 493	0,04
ABN AMRO Bank NV FRN 16 - 18.01.28	800 000	EUR	836 332	831 256	0,04
ABN AMRO Bank NV 4.125% 12 - 28.03.22	900 000	EUR	961 784	964 602	0,04
ABN AMRO Bank NV 7.125% 12 - 07.06.22	700 000	EUR	796 834	788 704	0,04
Achmea Bank NV 1.125% 15 - 25.04.22	790 000	EUR	803 484	798 508	0,04
Achmea BV 1.50% 20 - 26.05.27	1 111 000	EUR	1 123 488	1 137 475	0,05
Achmea BV FRN 15 - 29.12.49	600 000	EUR	634 021	625 752	0,03
Achmea BV FRN 13 - 04.04.43	400 000	EUR	455 046	437 160	0,02
Adecco International Financial Services BV 1.00% 16 - 12.02.24	933 000	EUR	954 401	959 245	0,04
Adecco International Financial Services BV 1.25% 19 - 20.11.29	244 000	EUR	249 432	244 693	0,01
Adecco International Financial Services BV 1.50% 15 - 22.11.22	218 000	EUR	222 825	223 402	0,01
Aegon Bank NV 0.625% 19 - 21.06.24	300 000	EUR	293 526	301 629	0,01
Aegon NV 1.00% 16 - 12.08.23	400 000	EUR	407 935	406 860	0,02
Aegon NV FRN 14 - 25.04.44	900 000	EUR	971 112	947 097	0,04
Airbus Finance BV 0.875% 16 - 13.05.26	404 000	EUR	409 114	401 212	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Airbus Finance BV 1.375% 16 - 13.05.31	850 000	EUR	879 084	864 042	0,04
Airbus Finance BV 2.125% 14 - 29.10.29	350 000	EUR	401 279	375 361	0,02
Airbus Finance BV 2.375% 14 - 04.02.24	675 000	EUR	725 531	711 794	0,03
Airbus SE 1.375% 20 - 06.09.26	160 000	EUR	159 756	162 467	0,01
Airbus SE 1.625% 20 - 04.07.25	598 000	EUR	616 512	615 940	0,03
Airbus SE 1.625% 20 - 04.07.25	200 000	EUR	206 356	206 000	0,01
Airbus SE 1.625% 20 - 06.09.30	160 000	EUR	158 912	162 421	0,01
Airbus SE 2.00% 20 - 04.07.28	798 000	EUR	842 426	842 887	0,04
Airbus SE 2.375% 20 - 04.07.32	997 000	EUR	1 100 342	1 094 098	0,05
Airbus SE 2.375% 20 - 06.09.40	100 000	EUR	99 201	104 042	0,00
Akzo Nobel NV 1.125% 16 - 04.08.26	300 000	EUR	304 111	315 330	0,01
Akzo Nobel NV 1.625% 20 - 14.04.30	898 000	EUR	951 290	945 845	0,04
Akzo Nobel NV 1.75% 14 - 11.07.24	383 000	EUR	415 433	407 681	0,02
Akzo Nobel NV 2.625% 12 - 27.07.22	750 000	EUR	786 831	789 503	0,04
Allianz Finance II BV Zero Coupon 20 - 14.01.25	200 000	EUR	200 940	200 150	0,01
Allianz Finance II BV Zero Coupon 20 - 14.01.25	100 000	EUR	99 469	100 075	0,00
Allianz Finance II BV 0.25% 17 - 06.06.23	400 000	EUR	401 240	403 460	0,02
Allianz Finance II BV 0.50% 20 - 14.01.31	700 000	EUR	708 702	704 151	0,03
Allianz Finance II BV 0.875% 17 - 12.06.27	800 000	EUR	846 153	846 112	0,04
Allianz Finance II BV 0.875% 19 - 15.01.26	500 000	EUR	517 960	521 980	0,02
Allianz Finance II BV 1.375% 16 - 21.04.31	600 000	EUR	614 490	657 180	0,03
Allianz Finance II BV 1.50% 19 - 15.01.30	1 000 000	EUR	1 074 415	1 112 940	0,05
Allianz Finance II BV 3.00% 13 - 13.03.28	700 000	EUR	846 660	860 167	0,04
Allianz Finance II BV 3.50% 12 - 14.02.22	1 300 000	EUR	1 374 474	1 375 842	0,06
Allianz Finance II BV FRN 11 - 07.08.41	1 000 000	EUR	1 067 511	1 046 390	0,05
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 1.125% 18 - 17.09.25	600 000	EUR	617 955	625 032	0,03
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 2.00% 18 - 17.09.30	600 000	EUR	660 737	670 098	0,03
Argentum Netherlands BV for Swiss Life AG FRN 15 - 29.12.49	900 000	EUR	990 008	993 087	0,04
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co. Ltd. FRN 19 - 19.02.49	500 000	EUR	515 428	537 330	0,02
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co. Ltd. FRN 16 - 10.01.46	598 000	EUR	669 873	667 039	0,03
ASML Holding NV 0.25% 20 - 25.02.30	571 000	EUR	565 820	550 632	0,02
ASML Holding NV 0.625% 16 - 07.07.22	820 000	EUR	830 615	829 159	0,04
ASML Holding NV 0.625% 20 - 05.07.29	1 298 000	EUR	1 299 325	1 305 295	0,06
ASML Holding NV 1.375% 16 - 07.07.26	758 000	EUR	800 053	810 363	0,04
ASML Holding NV 1.625% 16 - 28.05.27	203 000	EUR	222 284	220 748	0,01
ASML Holding NV 3.375% 13 - 19.09.23	550 000	EUR	600 453	607 662	0,03
ASR Nederland NV FRN 19 - 05.02.49	629 000	EUR	657 720	652 738	0,03
ASR Nederland NV FRN 14 - 30.09.49	300 000	EUR	328 460	326 991	0,01
ASR Nederland NV FRN 15 - 29.09.45	500 000	EUR	583 023	567 170	0,03
ATF Netherlands BV FRN 16 - 29.12.49	700 000	EUR	725 504	693 609	0,03
ATF Netherlands BV FRN 16 - 29.12.49	200 000	EUR	196 803	198 174	0,01
BASF Finance Europe NV 0.75% 16 - 11.10.26	424 000	EUR	445 103	441 719	0,02
BAT Netherlands Finance BV 2.375% 20 - 10.07.24	1 178 000	EUR	1 230 531	1 245 134	0,06
BAT Netherlands Finance BV 3.125% 20 - 04.07.28	878 000	EUR	946 390	972 306	0,04
BAT Netherlands Finance BV 3.125% 20 - 04.07.28	200 000	EUR	213 840	221 482	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Bayer Capital Corp. BV 0.625% 18 - 15.12.22	1 000 000	EUR	1 011 834	1 009 280	0,05
Bayer Capital Corp. BV 1.25% 14 - 13.11.23	704 000	EUR	717 981	727 232	0,03
Bayer Capital Corp. BV 1.50% 18 - 26.06.26	1 400 000	EUR	1 441 114	1 472 338	0,07
Bayer Capital Corp. BV 2.125% 18 - 15.12.29	1 500 000	EUR	1 607 872	1 669 740	0,07
BMW Finance NV Zero Coupon 19 - 24.03.23	1 000 000	EUR	1 001 191	990 720	0,04
BMW Finance NV Zero Coupon 20 - 14.04.23	580 000	EUR	579 856	573 643	0,03
BMW Finance NV 0.125% 18 - 29.11.21	720 000	EUR	720 707	720 749	0,03
BMW Finance NV 0.125% 19 - 13.07.22	1 310 000	EUR	1 310 996	1 306 253	0,06
BMW Finance NV 0.25% 18 - 14.01.22	809 000	EUR	811 952	810 885	0,04
BMW Finance NV 0.375% 18 - 07.10.23	1 400 000	EUR	1 391 022	1 400 826	0,06
BMW Finance NV 0.375% 19 - 24.09.27	574 000	EUR	574 128	562 417	0,03
BMW Finance NV 0.375% 20 - 14.01.27	1 110 000	EUR	1 106 458	1 097 379	0,05
BMW Finance NV 0.50% 18 - 22.11.22	1 000 000	EUR	1 002 960	1 006 030	0,04
BMW Finance NV 0.625% 19 - 10.06.23	1 706 000	EUR	1 725 150	1 722 326	0,08
BMW Finance NV 0.75% 16 - 15.04.24	779 000	EUR	773 777	791 300	0,04
BMW Finance NV 0.75% 17 - 07.12.24	300 000	EUR	303 945	305 211	0,01
BMW Finance NV 0.75% 19 - 13.07.26	1 000 000	EUR	1 018 214	1 014 270	0,05
BMW Finance NV 0.875% 17 - 04.03.25	450 000	EUR	440 990	460 166	0,02
BMW Finance NV 0.875% 20 - 14.01.32	570 000	EUR	555 831	577 929	0,03
BMW Finance NV 1.00% 15 - 21.01.25	468 000	EUR	489 277	481 488	0,02
BMW Finance NV 1.00% 16 - 15.02.22	639 000	EUR	649 230	647 039	0,03
BMW Finance NV 1.00% 18 - 29.08.25	374 000	EUR	384 238	385 250	0,02
BMW Finance NV 1.00% 18 - 29.08.25	100 000	EUR	96 236	103 008	0,00
BMW Finance NV 1.00% 18 - 14.11.24	1 100 000	EUR	1 119 605	1 127 797	0,05
BMW Finance NV 1.125% 18 - 01.10.28	788 000	EUR	815 416	817 274	0,04
BMW Finance NV 1.125% 18 - 22.05.26	588 000	EUR	601 848	612 061	0,03
BMW Finance NV 1.25% 14 - 09.05.22	750 000	EUR	763 584	766 718	0,03
BMW Finance NV 1.50% 19 - 02.06.29	1 349 000	EUR	1 407 207	1 417 246	0,06
BMW Finance NV 2.375% 13 - 24.01.23	588 000	EUR	621 337	620 487	0,03
BMW Finance NV 2.625% 14 - 17.01.24	400 000	EUR	434 187	432 428	0,02
Brenntag Finance BV 1.125% 17 - 27.09.25	900 000	EUR	913 334	897 966	0,04
Bunge Finance Europe BV 1.85% 16 - 16.06.23	1 072 000	EUR	1 087 907	1 079 879	0,05
Cetin Finance BV 1.423% 16 - 12.06.21	473 000	EUR	481 270	478 037	0,02
Citycon Treasury BV 1.25% 16 - 09.08.26	350 000	EUR	317 924	294 858	0,01
Citycon Treasury BV 2.375% 18 - 15.01.27	355 000	EUR	325 617	310 224	0,01
Citycon Treasury BV 2.50% 14 - 10.01.24	365 000	EUR	373 306	344 184	0,02
Coca-Cola HBC Finance BV 0.625% 19 - 21.11.29	302 000	EUR	293 366	295 459	0,01
Coca-Cola HBC Finance BV 1.00% 19 - 14.05.27	766 000	EUR	770 158	785 610	0,04
Coca-Cola HBC Finance BV 1.625% 19 - 14.05.31	300 000	EUR	311 628	319 863	0,01
Coca-Cola HBC Finance BV 1.875% 16 - 11.11.24	865 000	EUR	924 324	922 064	0,04
Compass Group Finance Netherlands BV 1.50% 18 - 09.05.28	306 000	EUR	328 264	323 035	0,01
Compass Group International BV 0.625% 17 - 07.03.24	800 000	EUR	796 333	807 840	0,04
Conti-Gummi Finance BV 1.125% 20 - 25.09.24	140 000	EUR	139 427	139 887	0,01
Conti-Gummi Finance BV 2.125% 20 - 27.11.23	1 081 000	EUR	1 113 450	1 115 235	0,05
Cooperatieve Rabobank UA 0.125% 16 - 10.11.21	500 000	EUR	501 370	501 925	0,02
Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 19 - 30.10.26	1 000 000	EUR	995 301	985 100	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Cooperatieve Rabobank UA 0.50% 17 - 12.06.22	801 000	EUR	809 894	812 582	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 0.625% 19 - 27.02.24	1 700 000	EUR	1 713 066	1 717 085	0,08
Cooperatieve Rabobank UA 0.75% 18 - 29.08.23	1 200 000	EUR	1 211 554	1 215 480	0,05
Cooperatieve Rabobank UA FRN 20 - 05.05.28	1 300 000	EUR	1 305 596	1 317 446	0,06
Cooperatieve Rabobank UA 1.125% 19 - 05.07.31	1 000 000	EUR	1 010 591	1 041 680	0,05
Cooperatieve Rabobank UA 1.25% 16 - 23.03.26	2 340 000	EUR	2 462 818	2 501 273	0,11
Cooperatieve Rabobank UA 1.375% 15 - 02.03.27	1 100 000	EUR	1 164 302	1 199 000	0,05
Cooperatieve Rabobank UA 2.375% 13 - 22.05.23	1 200 000	EUR	1 271 676	1 285 788	0,06
Cooperatieve Rabobank UA 3.875% 13 - 25.07.23	450 000	EUR	497 959	494 586	0,02
Cooperatieve Rabobank UA 3.875% 13 - 25.07.23	100 000	EUR	111 368	109 908	0,00
Cooperatieve Rabobank UA 4.00% 12 - 01.11.22	1 350 000	EUR	1 429 732	1 434 982	0,06
Cooperatieve Rabobank UA 4.125% 10 - 14.07.25	2 100 000	EUR	2 491 874	2 537 409	0,11
Cooperatieve Rabobank UA 4.125% 12 - 14.09.22	800 000	EUR	867 269	866 400	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 4.375% 06 - 06.07.21	400 000	EUR	417 382	416 912	0,02
Cooperatieve Rabobank UA 4.75% 07 - 06.06.22	1 451 000	EUR	1 586 796	1 586 828	0,07
Cooperatieve Rabobank UA 4.75% 07 - 06.06.22	650 000	EUR	708 017	710 847	0,03
CRH Funding BV 1.625% 20 - 05.05.30	1 007 000	EUR	1 023 854	1 056 424	0,05
CRH Funding BV 1.875% 15 - 01.09.24	300 000	EUR	306 316	314 718	0,01
Daimler International Finance BV 0.20% 17 - 13.09.21	400 000	EUR	401 046	399 280	0,02
Daimler International Finance BV 0.25% 18 - 05.11.22	523 000	EUR	518 853	520 369	0,02
Daimler International Finance BV 0.25% 18 - 05.11.22	987 000	EUR	983 588	982 035	0,04
Daimler International Finance BV 0.25% 18 - 08.09.21	1 050 000	EUR	1 049 566	1 049 139	0,05
Daimler International Finance BV 0.25% 19 - 11.06.23	790 000	EUR	790 273	770 187	0,03
Daimler International Finance BV 0.25% 19 - 11.06.23	900 000	EUR	874 719	877 428	0,04
Daimler International Finance BV 0.625% 19 - 27.02.23	1 497 000	EUR	1 507 162	1 494 290	0,07
Daimler International Finance BV 0.625% 19 - 05.06.27	950 000	EUR	948 804	900 039	0,04
Daimler International Finance BV 0.625% 19 - 05.06.27	207 000	EUR	187 921	196 114	0,01
Daimler International Finance BV 0.875% 18 - 04.09.24	312 000	EUR	318 411	310 980	0,01
Daimler International Finance BV 0.875% 18 - 04.09.24	300 000	EUR	291 702	299 019	0,01
Daimler International Finance BV 1.00% 18 - 11.11.25	750 000	EUR	760 298	743 408	0,03
Daimler International Finance BV 1.00% 18 - 11.11.25	545 000	EUR	526 115	540 209	0,02
Daimler International Finance BV 1.375% 19 26.06.26	830 000	EUR	842 936	835 345	0,04
Daimler International Finance BV 1.50% 18 - 02.09.27	80 000	EUR	79 894	80 786	0,00
Daimler International Finance BV 1.50% 18 - 02.09.27	410 000	EUR	424 548	414 030	0,02
de Volksbank NV 0.01% 19 - 16.09.24	300 000	EUR	296 430	297 507	0,01
de Volksbank NV 0.75% 18 - 25.06.23	900 000	EUR	906 481	910 215	0,04
Deutsche Post Finance BV 2.95% 12 - 27.06.22	900 000	EUR	954 560	957 132	0,04
Deutsche Telekom International Finance BV 0.625% 16 - 04.03.23	2 021 000	EUR	2 043 634	2 046 343	0,09
Deutsche Telekom International Finance BV 0.625% 17 - 13.12.24	674 000	EUR	685 256	685 242	0,03
Deutsche Telekom International Finance BV 0.625% 18 - 12.01.22	400 000	EUR	406 243	404 816	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 0.875% 17 - 30.01.24	1 750 000	EUR	1 780 392	1 797 232	0,08
Deutsche Telekom International Finance BV 1.125% 17 - 22.05.26	585 000	EUR	593 907	610 962	0,03
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 17 - 30.01.27	1 400 000	EUR	1 452 694	1 483 188	0,07
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 18 - 12.01.25	373 000	EUR	389 223	394 205	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Deutsche Telekom International Finance BV 1.50% 16 - 04.03.28	1 332 000	EUR	1 391 649	1 421 977	0,06
Deutsche Telekom International Finance BV 2.00% 18 - 12.01.29	766 000	EUR	816 859	853 224	0,04
Deutsche Telekom International Finance BV 2.75% 12 - 24.10.24	550 000	EUR	606 219	610 016	0,03
Deutsche Telekom International Finance BV 3.25% 13 - 17.01.28	700 000	EUR	805 561	834 505	0,04
Deutsche Telekom International Finance BV 4.25% 10 - 13.07.22	1 145 000	EUR	1 240 581	1 236 909	0,06
Deutsche Telekom International Finance BV 4.50% 10 - 28.10.30	327 000	EUR	443 384	443 088	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 4.875% 10 - 22.04.25	400 000	EUR	476 138	489 896	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 7.50% 03 - 24.01.33	492 000	EUR	855 115	849 846	0,04
Digital Dutch Finco BV 0.125% 20 - 15.10.22	604 000	EUR	606 316	596 571	0,03
Digital Dutch Finco BV 0.625% 20 - 15.07.25	542 000	EUR	544 640	535 436	0,02
Digital Dutch Finco BV 1.25% 20 - 02.01.31	400 000	EUR	397 455	397 804	0,02
Digital Dutch Finco BV 1.50% 20 - 15.03.30	910 000	EUR	936 778	931 312	0,04
EDP Finance BV 0.375% 19 - 16.09.26	240 000	EUR	239 566	236 282	0,01
EDP Finance BV 1.125% 16 - 02.12.24	1 542 000	EUR	1 572 080	1 585 901	0,07
EDP Finance BV 1.50% 17 - 22.11.27	400 000	EUR	422 679	423 264	0,02
EDP Finance BV 1.625% 18 - 26.01.26	700 000	EUR	733 198	738 423	0,03
EDP Finance BV 1.875% 17 - 29.09.23	400 000	EUR	414 160	420 084	0,02
EDP Finance BV 1.875% 18 - 13.10.25	400 000	EUR	411 752	429 316	0,02
EDP Finance BV 2.00% 15 - 22.04.25	500 000	EUR	530 980	536 725	0,02
EDP Finance BV 2.375% 16 - 23.03.23	500 000	EUR	523 664	528 925	0,02
EDP Finance BV 2.625% 14 - 18.01.22	897 000	EUR	928 253	931 131	0,04
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG FRN 17 - 29.09.47	400 000	EUR	439 908	424 552	0,02
ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group FRN 16 - 29.12.49	471 000	EUR	554 105	536 818	0,02
ELM BV for Swiss Reinsurance Co. Ltd. FRN 15 - 29.12.49	800 000	EUR	824 692	831 880	0,04
Enel Finance International NV Zero Coupon 19 - 17.06.24	1 280 000	EUR	1 271 497	1 264 986	0,06
Enel Finance International NV 0.375% 19 - 17.06.27	955 000	EUR	952 648	944 256	0,04
Enel Finance International NV 1.00% 17 - 16.09.24	900 000	EUR	914 812	928 971	0,04
Enel Finance International NV 1.125% 18 - 16.09.26	1 100 000	EUR	1 124 553	1 154 065	0,05
Enel Finance International NV 1.125% 19 - 17.10.34	500 000	EUR	497 285	517 645	0,02
Enel Finance International NV 1.375% 16 - 06.01.26	1 450 000	EUR	1 510 780	1 545 279	0,07
Enel Finance International NV 1.50% 19 - 21.07.25	720 000	EUR	757 192	762 869	0,03
Enel Finance International NV 1.966% 15 - 27.01.25	1 131 000	EUR	1 185 576	1 219 037	0,05
Enel Finance International NV 4.875% 12 - 17.04.23	1 085 000	EUR	1 231 111	1 231 497	0,06
Enel Finance International NV 5.00% 09 - 14.09.22	1 372 000	EUR	1 520 297	1 522 056	0,07
Enel Finance International NV 5.00% 11 - 07.12.21	100 000	EUR	105 421	105 042	0,00
Euronext NV 1.00% 18 - 18.04.25	150 000	EUR	154 211	154 016	0,01
Euronext NV 1.125% 19 - 06.12.29	500 000	EUR	507 765	515 640	0,02
Evonik Finance BV 0.375% 16 - 09.07.24	1 112 000	EUR	1 115 396	1 117 026	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
EXOR NV 1.75% 18 - 18.01.28	850 000	EUR	870 957	862 563	0,04
EXOR NV 1.75% 19 - 14.10.34	160 000	EUR	154 726	147 282	0,01
EXOR NV 2.125% 15 - 12.02.22	1 050 000	EUR	1 084 830	1 082 697	0,05
EXOR NV 2.25% 20 - 29.04.30	400 000	EUR	406 166	403 920	0,02
EXOR NV 2.50% 14 - 10.08.24	650 000	EUR	696 302	690 801	0,03
Givaudan Finance Europe BV 1.00% 20 - 22.04.27	899 000	EUR	925 322	931 805	0,04
Givaudan Finance Europe BV 1.625% 20 - 22.04.32	399 000	EUR	424 652	428 295	0,02
Heineken NV 1.00% 16 - 05.04.26	400 000	EUR	408 918	412 960	0,02
Heineken NV 1.25% 15 - 09.10.21	300 000	EUR	303 932	302 955	0,01
Heineken NV 1.25% 18 - 17.03.27	598 000	EUR	620 029	625 418	0,03
Heineken NV 1.25% 20 - 05.07.33	800 000	EUR	798 884	803 928	0,04
Heineken NV 1.375% 16 - 29.01.27	415 000	EUR	421 546	439 058	0,02
Heineken NV 1.50% 15 - 12.07.24	282 000	EUR	298 566	296 015	0,01
Heineken NV 1.50% 17 - 10.03.29	500 000	EUR	528 902	538 160	0,02
Heineken NV 1.625% 20 - 30.03.25	955 000	EUR	990 354	1 011 727	0,05
Heineken NV 1.75% 18 - 17.03.31	700 000	EUR	736 134	764 575	0,03
Heineken NV 1.75% 20 - 05.07.40	780 000	EUR	793 484	783 284	0,04
Heineken NV 2.25% 20 - 30.03.30	1 238 000	EUR	1 344 743	1 401 466	0,06
Heineken NV 2.875% 12 - 08.04.25	523 000	EUR	597 568	587 313	0,03
Heineken NV 3.50% 12 - 19.03.24	415 000	EUR	467 105	464 281	0,02
Iberdrola International BV 0.375% 16 - 15.09.25	500 000	EUR	504 142	502 795	0,02
Iberdrola International BV 1.125% 15 - 27.01.23	700 000	EUR	719 922	717 563	0,03
Iberdrola International BV 1.125% 16 - 21.04.26	1 000 000	EUR	1 042 795	1 049 620	0,05
Iberdrola International BV 1.75% 15 - 17.09.23	700 000	EUR	737 666	735 287	0,03
Iberdrola International BV 1.875% 14 - 10.08.24	800 000	EUR	851 628	857 248	0,04
Iberdrola International BV FRN 17 - 31.12.99	1 300 000	EUR	1 295 111	1 299 285	0,06
Iberdrola International BV 2.50% 14 - 24.10.22	600 000	EUR	634 720	633 132	0,03
Iberdrola International BV FRN 18 - 31.12.99	500 000	EUR	515 121	514 570	0,02
Iberdrola International BV 3.00% 13 - 31.01.22	300 000	EUR	314 227	313 692	0,01
Iberdrola International BV FRN 19 - 31.12.99	600 000	EUR	627 852	635 808	0,03
ING Bank NV Zero Coupon 19 - 04.08.22	1 200 000	EUR	1 202 343	1 197 060	0,05
ING Bank NV 0.375% 18 - 26.11.21	1 700 000	EUR	1 706 779	1 707 089	0,08
ING Bank NV 4.50% 12 - 21.02.22	1 436 000	EUR	1 540 170	1 540 426	0,07
ING Groep NV FRN 19 - 09.03.25	200 000	EUR	199 126	195 628	0,01
ING Groep NV FRN 19 - 09.03.25	400 000	EUR	394 879	391 256	0,02
ING Groep NV 0.75% 17 - 03.09.22	1 300 000	EUR	1 309 807	1 310 894	0,06
ING Groep NV 1.00% 18 - 20.09.23	800 000	EUR	806 469	816 936	0,04
ING Groep NV FRN 19 - 13.11.30	1 100 000	EUR	1 080 297	1 060 312	0,05
ING Groep NV 1.125% 18 - 14.02.25	700 000	EUR	715 752	720 118	0,03
ING Groep NV 1.375% 17 - 01.11.28	400 000	EUR	425 984	424 312	0,02
ING Groep NV FRN 17 - 26.09.29	1 300 000	EUR	1 281 756	1 307 748	0,06
ING Groep NV FRN 18 - 22.03.30	600 000	EUR	590 609	613 236	0,03
ING Groep NV 2.00% 18 - 20.09.28	1 300 000	EUR	1 364 891	1 446 185	0,06
ING Groep NV 2.125% 19 - 01.10.26	1 000 000	EUR	1 071 961	1 087 440	0,05
ING Groep NV FRN 20 - 26.05.31	1 800 000	EUR	1 821 566	1 842 246	0,08
ING Groep NV FRN 17 - 15.02.29	900 000	EUR	939 757	935 865	0,04
ING Groep NV 2.50% 18 - 15.11.30	1 300 000	EUR	1 453 357	1 537 081	0,07
ING Groep NV FRN 17 - 04.11.28	1 400 000	EUR	1 453 788	1 468 432	0,07
innogy Finance BV 0.75% 18 - 30.11.22	249 000	EUR	252 524	251 744	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
innogy Finance BV 1.00% 17 - 13.04.25	600 000	EUR	614 550	620 460	0,03
innogy Finance BV 1.25% 17 - 19.10.27	182 000	EUR	180 624	192 512	0,01
innogy Finance BV 1.50% 18 - 31.07.29	1 300 000	EUR	1 331 997	1 392 521	0,06
innogy Finance BV 3.00% 13 - 17.01.24	800 000	EUR	883 786	877 568	0,04
innogy Finance BV 5.75% 03 - 14.02.33	450 000	EUR	713 270	704 282	0,03
innogy Finance BV 6.50% 09 - 08.10.21	600 000	EUR	642 035	641 964	0,03
Innogy Finance BV 1.625% 18 - 30.05.26	600 000	EUR	633 332	644 652	0,03
JAB Holdings BV 1.00% 19 - 20.12.27	600 000	EUR	613 170	582 834	0,03
JAB Holdings BV 1.25% 17 - 22.05.24	900 000	EUR	923 329	914 832	0,04
JAB Holdings BV 1.50% 14 - 24.11.21	300 000	EUR	306 186	304 047	0,01
JAB Holdings BV 1.625% 15 - 30.04.25	300 000	EUR	303 278	310 302	0,01
JAB Holdings BV 1.625% 15 - 30.04.25	600 000	EUR	621 338	620 604	0,03
JAB Holdings BV 1.75% 16 - 25.05.23	500 000	EUR	518 204	515 605	0,02
JAB Holdings BV 1.75% 18 - 25.06.26	700 000	EUR	727 704	721 133	0,03
JAB Holdings BV 2.00% 17 - 18.05.28	600 000	EUR	618 106	625 176	0,03
JAB Holdings BV 2.125% 15 - 16.09.22	300 000	EUR	314 636	310 326	0,01
JAB Holdings BV 2.25% 19 - 19.12.39	600 000	EUR	600 534	592 224	0,03
JAB Holdings BV 2.50% 18 - 25.06.29	700 000	EUR	738 124	757 533	0,03
JAB Holdings BV 2.50% 20 - 17.04.27	400 000	EUR	410 393	426 172	0,02
JAB Holdings BV 3.375% 20 - 17.04.35	400 000	EUR	434 904	463 288	0,02
JAB Holdings BV 3.375% 20 - 17.04.35	200 000	EUR	216 815	231 644	0,01
JT International Financial Services BV 1.00% 19 - 26.11.29	214 000	EUR	215 401	215 329	0,01
JT International Financial Services BV 1.125% 18 - 28.09.25	810 000	EUR	825 927	839 970	0,04
Koninklijke Ahold Delhaize NV 0.25% 19 - 26.06.25	300 000	EUR	300 408	298 665	0,01
Koninklijke Ahold Delhaize NV 0.875% 17 - 19.09.24	600 000	EUR	613 128	612 858	0,03
Koninklijke Ahold Delhaize NV 1.125% 18 - 19.03.26	100 000	EUR	99 446	103 829	0,00
Koninklijke Ahold Delhaize NV 1.75% 20 - 04.02.27	879 000	EUR	907 765	952 722	0,04
Koninklijke DSM NV 0.25% 20 - 23.06.28	200 000	EUR	199 308	200 102	0,01
Koninklijke DSM NV 0.625% 20 - 23.06.32	400 000	EUR	396 518	399 636	0,02
Koninklijke DSM NV 0.75% 16 - 28.09.26	500 000	EUR	500 743	519 570	0,02
Koninklijke DSM NV 1.00% 15 - 04.09.25	592 000	EUR	617 216	616 343	0,03
Koninklijke DSM NV 1.375% 15 - 26.09.22	500 000	EUR	512 693	516 370	0,02
Koninklijke DSM NV 2.375% 14 - 04.03.24	200 000	EUR	213 073	216 072	0,01
Koninklijke KPN NV 0.625% 16 - 04.09.25	400 000	EUR	393 865	399 640	0,02
Koninklijke KPN NV 1.125% 16 - 09.11.28	600 000	EUR	612 010	608 664	0,03
Koninklijke KPN NV 4.25% 12 - 03.01.22	800 000	EUR	854 579	853 944	0,04
Koninklijke KPN NV 5.625% 09 - 30.09.24	400 000	EUR	483 618	483 624	0,02
Koninklijke Philips NV 0.50% 17 - 09.06.23	900 000	EUR	906 392	910 701	0,04
Koninklijke Philips NV 0.50% 19 - 22.05.26	740 000	EUR	747 678	747 541	0,03
Koninklijke Philips NV 0.75% 18 - 05.02.24	419 000	EUR	424 834	427 841	0,02
Koninklijke Philips NV 1.375% 18 - 05.02.28	427 000	EUR	454 087	458 961	0,02
Koninklijke Philips NV 1.375% 20 - 30.03.25	579 000	EUR	595 181	605 593	0,03
Koninklijke Philips NV 2.00% 20 - 30.03.30	507 000	EUR	547 821	564 666	0,03
LeasePlan Corp. NV 0.125% 19 - 13.09.23	500 000	EUR	495 821	481 990	0,02
LeasePlan Corp. NV 0.125% 19 - 13.09.23	500 000	EUR	491 642	481 990	0,02
LeasePlan Corp. NV 0.75% 17 - 10.03.22	842 000	EUR	848 218	831 475	0,04
LeasePlan Corp. NV 1.00% 18 - 05.02.23	550 000	EUR	553 962	545 633	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
LeasePlan Corp. NV 1.00% 19 - 25.02.22	849 000	EUR	841 888	844 696	0,04
LeasePlan Corp. NV 1.375% 19 - 03.07.24	150 000	EUR	154 104	150 456	0,01
LeasePlan Corp. NV 3.50% 20 - 04.09.25	499 000	EUR	521 279	543 695	0,02
Linde Finance BV 0.25% 17 - 18.01.22	708 000	EUR	710 358	711 611	0,03
Linde Finance BV 0.25% 20 - 19.05.27	600 000	EUR	600 329	604 296	0,03
Linde Finance BV 0.25% 20 - 19.05.27	200 000	EUR	200 267	201 432	0,01
Linde Finance BV 0.55% 20 - 19.05.32	800 000	EUR	800 786	804 520	0,04
Linde Finance BV 1.00% 16 - 20.04.28	658 000	EUR	690 025	706 350	0,03
Linde Finance BV 1.875% 14 - 22.05.24	389 000	EUR	414 729	419 101	0,02
Linde Finance BV 2.00% 13 - 18.04.23	750 000	EUR	792 525	792 938	0,04
LYB International Finance II BV 0.875% 19 - 17.09.26	400 000	EUR	399 621	383 772	0,02
LYB International Finance II BV 1.625% 19 - 17.09.31	283 000	EUR	292 186	270 831	0,01
LYB International Finance II BV 1.875% 16 - 03.02.22	730 000	EUR	741 868	739 162	0,03
Madrilena Red de Gas Finance BV 1.375% 17 - 04.11.25	400 000	EUR	404 940	412 508	0,02
Madrilena Red de Gas Finance BV 2.25% 17 - 04.11.29	400 000	EUR	426 354	424 944	0,02
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.875% 19 - 10.01.31	600 000	EUR	594 737	601 338	0,03
Mylan NV 2.25% 16 - 22.11.24	1 158 000	EUR	1 183 133	1 213 352	0,05
Mylan NV 3.125% 16 - 22.11.28	509 000	EUR	563 250	572 182	0,03
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.375% 19 - 31.05.23	300 000	EUR	303 864	298 161	0,01
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.375% 19 - 26.02.25	200 000	EUR	199 326	196 990	0,01
Nationale-Nederlanden Levensverzekering Maatschappij NV FRN 12 - 29.08.42	524 000	EUR	648 462	607 473	0,03
Naturgy Finance BV 0.75% 19 - 28.11.29	700 000	EUR	699 002	700 525	0,03
Naturgy Finance BV 0.875% 17 - 15.05.25	600 000	EUR	603 756	616 962	0,03
Naturgy Finance BV 1.25% 16 - 19.04.26	300 000	EUR	316 694	312 942	0,01
Naturgy Finance BV 1.25% 20 - 15.01.26	1 000 000	EUR	1 028 134	1 040 220	0,05
Naturgy Finance BV 1.375% 15 - 21.01.25	700 000	EUR	727 954	735 028	0,03
Naturgy Finance BV 1.375% 17 - 19.01.27	1 100 000	EUR	1 114 877	1 157 607	0,05
Naturgy Finance BV 1.50% 18 - 29.01.28	500 000	EUR	517 164	532 585	0,02
Naturgy Finance BV 1.875% 17 - 10.05.29	300 000	EUR	309 840	331 458	0,01
Naturgy Finance BV 2.875% 14 - 03.11.24	400 000	EUR	434 545	437 952	0,02
Naturgy Finance BV 3.875% 13 - 17.01.23	200 000	EUR	218 993	218 214	0,01
Naturgy Finance BV 3.875% 13 - 04.11.22	100 000	EUR	106 710	106 510	0,00
NE Property BV 1.75% 17 - 23.11.24	350 000	EUR	317 644	338 856	0,02
NE Property BV 1.875% 19 - 10.09.26	400 000	EUR	395 231	371 944	0,02
NE Property BV 2.625% 19 - 22.05.23	571 000	EUR	570 077	577 509	0,03
NIBC Bank NV 0.875% 19 - 07.08.25	600 000	EUR	598 801	584 160	0,03
NIBC Bank NV 1.125% 18 - 19.04.23	350 000	EUR	348 963	348 093	0,02
NIBC Bank NV 1.50% 17 - 31.01.22	443 000	EUR	452 054	446 867	0,02
NIBC Bank NV 2.00% 19 - 04.09.24	700 000	EUR	711 422	695 996	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
NN Group NV 0.875% 17 - 13.01.23	700 000	EUR	710 067	706 783	0,03
NN Group NV 1.00% 15 - 18.03.22	400 000	EUR	405 341	404 304	0,02
NN Group NV 1.625% 17 - 06.01.27	400 000	EUR	411 180	423 156	0,02
NN Group NV FRN 14 - 29.06.49	700 000	EUR	762 633	750 736	0,03
NN Group NV FRN 14 - 15.07.49	750 000	EUR	816 385	816 623	0,04
NN Group NV FRN 14 - 04.08.44	1 100 000	EUR	1 202 288	1 200 430	0,05
NN Group NV FRN 17 - 13.01.48	800 000	EUR	905 999	908 488	0,04
PACCAR Financial Europe BV Zero Coupon 20 - 03.03.23	200 000	EUR	200 718	196 158	0,01
PACCAR Financial Europe BV Zero Coupon 20 - 03.03.23	200 000	EUR	194 319	196 158	0,01
PACCAR Financial Europe BV 0.125% 19 - 03.07.22	100 000	EUR	100 316	98 439	0,00
PostNL NV 0.625% 19 - 23.09.26	30 000	EUR	29 813	29 381	0,00
PostNL NV 0.625% 19 - 23.09.26	100 000	EUR	99 728	97 935	0,00
PostNL NV 1.00% 17 - 21.11.24	300 000	EUR	306 042	301 704	0,01
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.375% 20 - 19.05.26	992 000	EUR	993 587	996 216	0,04
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.75% 20 - 19.05.30	992 000	EUR	1 000 671	1 008 259	0,05
Redexis Gas Finance BV 1.875% 15 - 27.04.27	400 000	EUR	413 214	414 344	0,02
Redexis Gas Finance BV 1.875% 20 - 28.05.25	800 000	EUR	806 576	826 496	0,04
RELX Finance BV Zero Coupon 20 - 18.03.24	780 000	EUR	755 331	769 509	0,03
RELX Finance BV 0.50% 20 - 03.10.28	1 006 000	EUR	953 651	986 705	0,04
RELX Finance BV 0.875% 20 - 03.10.32	579 000	EUR	548 036	569 001	0,03
RELX Finance BV 1.00% 17 - 22.03.24	400 000	EUR	411 663	409 032	0,02
RELX Finance BV 1.375% 16 - 05.12.26	570 000	EUR	603 073	598 739	0,03
RELX Finance BV 1.50% 18 - 13.05.27	200 000	EUR	201 264	210 760	0,01
Ren Finance BV 1.75% 16 - 06.01.23	782 000	EUR	812 602	812 764	0,04
Ren Finance BV 1.75% 18 - 18.01.28	100 000	EUR	103 998	106 795	0,00
Ren Finance BV 2.50% 15 - 02.12.25	392 000	EUR	421 316	425 920	0,02
Repsol International Finance BV 0.25% 19 - 08.02.27	600 000	EUR	585 870	573 498	0,03
Repsol International Finance BV 0.50% 17 - 23.05.22	200 000	EUR	201 350	200 656	0,01
Repsol International Finance BV 2.00% 20 - 15.12.25	1 100 000	EUR	1 129 950	1 176 978	0,05
Repsol International Finance BV 2.25% 14 - 12.10.26	100 000	EUR	105 131	109 406	0,00
Repsol International Finance BV 2.625% 20 - 15.04.30	1 000 000	EUR	1 073 794	1 112 120	0,05
Repsol International Finance BV 3.625% 13 - 10.07.21	1 000 000	EUR	1 045 798	1 041 260	0,05
Robert Bosch Investment Nederland BV 2.625% 13 - 24.05.28	600 000	EUR	696 184	708 810	0,03
Roche Finance Europe BV 0.50% 16 - 27.02.23	718 000	EUR	726 792	729 624	0,03
Roche Finance Europe BV 0.875% 15 - 25.02.25	840 000	EUR	870 982	876 431	0,04
Schaeffler Finance BV 3.25% 15 - 15.05.25	487 000	EUR	498 275	482 602	0,02
Schlumberger Finance BV Zero Coupon 19 - 15.10.24	399 000	EUR	398 119	389 935	0,02
Schlumberger Finance BV 0.25% 19 - 15.10.27	470 000	EUR	469 054	443 845	0,02
Schlumberger Finance BV 0.25% 19 - 15.10.27	303 000	EUR	277 258	286 138	0,01
Schlumberger Finance BV 0.50% 19 - 15.10.31	803 000	EUR	718 759	741 273	0,03
Schlumberger Finance BV 1.375% 20 - 28.10.26	1 097 000	EUR	1 095 274	1 121 518	0,05
Schlumberger Finance BV 2.00% 20 - 05.06.32	1 014 000	EUR	1 032 856	1 084 574	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Shell International Finance BV 0.125% 19 - 11.08.27	840 000	EUR	803 238	821 478	0,04
Shell International Finance BV 0.375% 16 - 15.02.25	1 590 000	EUR	1 594 843	1 610 241	0,07
Shell International Finance BV 0.50% 19 - 11.08.31	1 012 000	EUR	979 303	972 471	0,04
Shell International Finance BV 0.50% 20 - 05.11.24	1 214 000	EUR	1 222 577	1 231 045	0,06
Shell International Finance BV 0.50% 20 - 05.11.24	100 000	EUR	100 944	101 404	0,00
Shell International Finance BV 0.75% 16 - 05.12.24	637 000	EUR	654 658	651 963	0,03
Shell International Finance BV 0.75% 16 - 15.08.28	400 000	EUR	382 382	408 244	0,02
Shell International Finance BV 0.875% 19 - 11.08.39	966 000	EUR	931 664	893 473	0,04
Shell International Finance BV 1.00% 14 - 04.06.22	500 000	EUR	509 791	509 045	0,02
Shell International Finance BV 1.125% 20 - 04.07.24	1 097 000	EUR	1 125 558	1 138 807	0,05
Shell International Finance BV 1.25% 15 - 15.03.22	952 000	EUR	972 929	973 772	0,04
Shell International Finance BV 1.25% 15 - 15.03.22	300 000	EUR	307 872	306 861	0,01
Shell International Finance BV 1.25% 16 - 05.12.28	1 050 000	EUR	1 114 735	1 112 548	0,05
Shell International Finance BV 1.25% 20 - 11.11.32	814 000	EUR	828 360	840 333	0,04
Shell International Finance BV 1.50% 20 - 04.07.28	1 097 000	EUR	1 159 353	1 183 795	0,05
Shell International Finance BV 1.50% 20 - 04.07.28	400 000	EUR	425 372	431 648	0,02
Shell International Finance BV 1.625% 14 - 20.01.27	962 000	EUR	1 044 312	1 043 982	0,05
Shell International Finance BV 1.875% 15 - 15.09.25	600 000	EUR	644 260	653 742	0,03
Shell International Finance BV 1.875% 15 - 15.09.25	200 000	EUR	219 162	217 914	0,01
Shell International Finance BV 1.875% 20 - 04.07.32	997 000	EUR	1 083 472	1 101 476	0,05
Shell International Finance BV 2.50% 14 - 24.03.26	500 000	EUR	543 888	565 010	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 19 - 09.05.21	1 085 000	EUR	1 086 487	1 084 913	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 19 - 09.05.24	190 000	EUR	191 497	189 061	0,01
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 20 - 20.02.23	1 300 000	EUR	1 303 814	1 298 258	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 20 - 20.02.26	1 300 000	EUR	1 292 483	1 288 638	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 20 - 20.02.26	200 000	EUR	196 959	198 252	0,01
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.125% 19 - 09.05.29	966 000	EUR	948 645	941 087	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.125% 20 - 06.05.22	1 500 000	EUR	1 501 821	1 503 750	0,07
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.25% 20 - 20.02.29	800 000	EUR	793 732	790 104	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.25% 20 - 06.05.24	1 100 000	EUR	1 101 969	1 106 303	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.30% 19 - 28.02.24	709 000	EUR	715 040	716 530	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.375% 18 - 09.06.23	900 000	EUR	908 605	909 900	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.375% 20 - 06.05.26	1 200 000	EUR	1 203 067	1 208 220	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.50% 19 - 09.05.34	990 000	EUR	975 954	950 449	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.50% 20 - 20.02.32	800 000	EUR	800 199	798 200	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.90% 19 - 28.02.28	480 000	EUR	498 168	501 379	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.00% 18 - 09.06.27	630 000	EUR	648 496	665 022	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.25% 19 - 28.02.31	706 000	EUR	742 125	757 234	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.375% 18 - 09.06.30	910 000	EUR	965 727	991 718	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.75% 19 - 28.02.39	713 000	EUR	760 400	795 915	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.875% 13 - 03.10.28	750 000	EUR	875 578	897 675	0,04
Signify NV 2.00% 20 - 05.11.24	1 050 000	EUR	1 056 374	1 062 442	0,05
Signify NV 2.375% 20 - 05.11.27	589 000	EUR	597 588	604 067	0,03
Sika Capital BV 0.875% 19 - 29.04.27	583 000	EUR	602 820	601 417	0,03
Sika Capital BV 1.50% 19 - 29.04.31	406 000	EUR	434 083	434 757	0,02
Sudzucker International Finance BV 1.00% 17 - 28.11.25	1 010 000	EUR	973 655	971 681	0,04
Sudzucker International Finance BV 1.25% 16 - 29.11.23	235 000	EUR	242 578	236 008	0,01
Telefonica Europe BV 5.875% 03 - 14.02.33	279 000	EUR	437 893	429 286	0,02
Telefonica Europe BV 5.875% 03 - 14.02.33	113 000	EUR	167 187	173 869	0,01
Toyota Motor Finance Netherlands BV 0.25% 19 - 01.10.22	100 000	EUR	99 835	100 029	0,00
Toyota Motor Finance Netherlands BV 0.25% 19 - 01.10.22	595 000	EUR	597 546	595 173	0,03
Toyota Motor Finance Netherlands BV 0.625% 18 - 26.09.23	656 000	EUR	661 009	662 855	0,03
Unilever NV Zero Coupon 17 - 31.07.21	100 000	EUR	99 995	99 959	0,00
Unilever NV 0.375% 17 - 14.02.23	900 000	EUR	912 557	911 934	0,04
Unilever NV 0.50% 15 - 02.03.22	599 000	EUR	605 802	604 792	0,03
Unilever NV 0.50% 15 - 02.03.22	489 000	EUR	492 277	493 729	0,02
Unilever NV 0.50% 16 - 29.04.24	350 000	EUR	355 745	358 908	0,02
Unilever NV 0.50% 18 - 08.12.23	490 000	EUR	491 180	499 717	0,02
Unilever NV 0.50% 18 - 01.06.25	1 140 000	EUR	1 161 626	1 169 857	0,05
Unilever NV 0.875% 17 - 31.07.25	300 000	EUR	311 404	313 545	0,01
Unilever NV 1.00% 15 - 06.03.23	300 000	EUR	305 880	310 077	0,01
Unilever NV 1.00% 17 - 14.02.27	700 000	EUR	730 983	743 764	0,03
Unilever NV 1.125% 16 - 29.04.28	500 000	EUR	531 829	539 515	0,02
Unilever NV 1.125% 18 - 02.12.27	436 000	EUR	455 991	467 505	0,02
Unilever NV 1.125% 18 - 02.12.27	100 000	EUR	107 574	107 226	0,00
Unilever NV 1.25% 20 - 25.03.25	1 358 000	EUR	1 414 680	1 436 031	0,06
Unilever NV 1.375% 17 - 31.07.29	630 000	EUR	661 940	699 596	0,03
Unilever NV 1.375% 18 - 09.04.30	300 000	EUR	319 701	335 550	0,02
Unilever NV 1.625% 18 - 02.12.33	688 000	EUR	761 135	789 803	0,04
Unilever NV 1.75% 20 - 25.03.30	1 358 000	EUR	1 483 023	1 541 289	0,07
Upjohn Finance BV 0.816% 20 - 23.06.22	110 000	EUR	110 000	110 696	0,00
Upjohn Finance BV 1.023% 20 - 23.06.24	170 000	EUR	170 000	171 357	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Upjohn Finance BV 1.362% 20 - 23.06.27	120 000	EUR	120 000	121 154	0,01
Upjohn Finance BV 1.908% 20 - 23.06.32	130 000	EUR	130 000	132 334	0,01
Vesteda Finance BV 1.50% 19 - 24.05.27	302 000	EUR	299 963	312 999	0,01
Vesteda Finance BV 2.00% 18 - 07.10.26	616 000	EUR	644 746	652 677	0,03
Volkswagen International Finance NV 0.875% 15 - 16.01.23	757 000	EUR	766 061	753 730	0,03
Volkswagen International Finance NV 1.125% 17 - 10.02.23	1 500 000	EUR	1 515 823	1 500 120	0,07
Volkswagen International Finance NV 1.625% 15 - 16.01.30	1 085 000	EUR	1 087 506	1 077 503	0,05
Volkswagen International Finance NV 1.875% 17 - 30.03.27	2 500 000	EUR	2 585 260	2 562 450	0,11
Volkswagen International Finance NV FRN 15 - 29.12.49	1 250 000	EUR	1 255 864	1 225 087	0,05
Volkswagen International Finance NV 2.625% 18 - 16.11.27	400 000	EUR	398 295	429 812	0,02
Volkswagen International Finance NV 2.625% 18 - 16.11.27	200 000	EUR	203 950	214 906	0,01
Volkswagen International Finance NV FRN 17 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 503 022	1 467 405	0,07
Volkswagen International Finance NV 3.25% 18 - 18.11.30	1 000 000	EUR	1 080 432	1 126 790	0,05
Volkswagen International Finance NV 3.30% 13 - 22.03.33	500 000	EUR	588 257	565 500	0,03
Volkswagen International Finance NV 3.30% 13 - 22.03.33	100 000	EUR	116 241	113 100	0,01
Volkswagen International Finance NV FRN 18 - 31.12.99	1 100 000	EUR	1 090 871	1 089 077	0,05
Volkswagen International Finance NV FRN 15 - 29.12.49	1 550 000	EUR	1 519 506	1 509 514	0,07
Volkswagen International Finance NV FRN 20 - 31.12.99	700 000	EUR	700 000	695 478	0,03
Volkswagen International Finance NV FRN 17 - 31.12.99	2 100 000	EUR	2 156 673	2 095 191	0,09
Volkswagen International Finance NV FRN 20 - 31.12.99	800 000	EUR	800 000	788 240	0,04
Volkswagen International Finance NV 4.125% 18 - 16.11.38	1 100 000	EUR	1 286 418	1 349 348	0,06
Volkswagen International Finance NV FRN 14 - 29.03.49	1 673 000	EUR	1 775 236	1 743 483	0,08
Volkswagen International Finance NV FRN 18 - 31.12.99	1 300 000	EUR	1 370 920	1 351 428	0,06
Volkswagen International Finance NV FRN 13 - 29.09.49	574 000	EUR	619 616	605 346	0,03
Vonovia Finance BV 0.125% 19 - 04.06.23	800 000	EUR	799 682	794 504	0,04
Vonovia Finance BV 0.50% 19 - 14.09.29	400 000	EUR	394 313	385 140	0,02
Vonovia Finance BV 0.625% 19 - 10.07.27	300 000	EUR	299 074	296 589	0,01
Vonovia Finance BV 0.75% 17 - 25.01.22	300 000	EUR	302 078	302 151	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Vonovia Finance BV 0.75% 18 - 15.01.24	800 000	EUR	798 086	810 536	0,04
Vonovia Finance BV 0.875% 16 - 06.10.22	100 000	EUR	100 911	101 112	0,00
Vonovia Finance BV 0.875% 18 - 07.03.23	700 000	EUR	706 208	710 892	0,03
Vonovia Finance BV 1.125% 17 - 09.08.25	300 000	EUR	302 783	308 886	0,01
Vonovia Finance BV 1.125% 19 - 14.09.34	500 000	EUR	486 862	486 100	0,02
Vonovia Finance BV 1.25% 16 - 12.06.24	600 000	EUR	608 367	622 782	0,03
Vonovia Finance BV 1.50% 15 - 31.03.25	400 000	EUR	412 789	419 888	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 16 - 06.10.26	500 000	EUR	521 006	524 150	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 14.01.28	700 000	EUR	719 259	735 336	0,03
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 22.03.26	400 000	EUR	413 564	420 892	0,02
Vonovia Finance BV 1.625% 19 - 10.07.39	700 000	EUR	680 519	690 025	0,03
Vonovia Finance BV 1.625% 20 - 04.07.24	400 000	EUR	413 965	417 044	0,02
Vonovia Finance BV 1.625% 20 - 04.07.24	700 000	EUR	722 001	729 827	0,03
Vonovia Finance BV 1.75% 17 - 25.01.27	200 000	EUR	200 791	213 212	0,01
Vonovia Finance BV 1.80% 19 - 29.06.25	200 000	EUR	203 142	212 198	0,01
Vonovia Finance BV 1.80% 19 - 29.06.25	300 000	EUR	314 767	318 297	0,01
Vonovia Finance BV 2.125% 14 - 07.09.22	300 000	EUR	313 504	310 869	0,01
Vonovia Finance BV 2.125% 18 - 22.03.30	300 000	EUR	328 031	331 953	0,01
Vonovia Finance BV 2.25% 15 - 15.12.23	500 000	EUR	524 874	533 180	0,02
Vonovia Finance BV 2.25% 20 - 04.07.30	800 000	EUR	868 074	891 560	0,04
Vonovia Finance BV 2.75% 18 - 22.03.38	400 000	EUR	442 493	463 096	0,02
Vonovia Finance BV 3.625% 13 - 10.08.21	400 000	EUR	416 778	416 428	0,02
Vonovia Finance BV FRN 14 - 29.12.49	1 200 000	EUR	1 235 832	1 228 668	0,05
Wintershall Dea Finance BV 0.452% 19 - 25.09.23	1 400 000	EUR	1 351 287	1 351 672	0,06
Wintershall Dea Finance BV 0.84% 19 - 25.09.25	900 000	EUR	898 998	852 696	0,04
Wintershall Dea Finance BV 1.332% 19 - 25.09.28	800 000	EUR	800 329	749 752	0,03
Wintershall Dea Finance BV 1.823% 19 - 25.09.31	900 000	EUR	895 179	842 688	0,04
Wolters Kluwer NV 0.75% 20 - 07.03.30	700 000	EUR	695 044	694 176	0,03
Wolters Kluwer NV 1.50% 17 - 22.03.27	200 000	EUR	210 776	211 444	0,01
Wolters Kluwer NV 2.875% 13 - 21.03.23	900 000	EUR	960 793	960 129	0,04
WPC Eurobond BV 1.35% 19 - 15.04.28	700 000	EUR	693 811	689 150	0,03
WPC Eurobond BV 2.125% 18 - 15.04.27	300 000	EUR	303 933	310 812	0,01
WPC Eurobond BV 2.25% 17 - 19.07.24	980 000	EUR	1 047 789	1 022 022	0,05
WPC Eurobond BV 2.25% 18 - 04.09.26	400 000	EUR	421 096	419 340	0,02
Wurth Finance International BV 0.75% 20 - 22.11.27	911 000	EUR	920 881	937 264	0,04
Wurth Finance International BV 1.00% 15 - 19.05.22	150 000	EUR	150 787	152 111	0,01
Wurth Finance International BV 1.00% 18 - 26.05.25	627 000	EUR	646 373	648 920	0,03
			364 717 571	366 501 618	16,36
Nouvelle-Zélande					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.375% 19 - 17.09.29	300 000	EUR	298 261	294 753	0,01
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.40% 17 - 03.01.22	400 000	EUR	401 784	402 052	0,02
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 1.125% 18 - 20.03.25	500 000	EUR	510 375	520 940	0,02
ASB Finance Ltd. 0.50% 17 - 06.10.22	800 000	EUR	806 425	805 504	0,04
ASB Finance Ltd. 0.50% 19 - 24.09.29	400 000	EUR	393 803	398 208	0,02
ASB Finance Ltd. 0.75% 19 - 13.03.24	750 000	EUR	760 774	765 517	0,03
BNZ International Funding Ltd. 0.375% 19 - 14.09.24	1 150 000	EUR	1 138 496	1 155 428	0,05
BNZ International Funding Ltd. 0.50% 17 - 13.05.23	385 000	EUR	390 188	387 572	0,02
BNZ International Funding Ltd. 0.625% 19 - 23.04.22	721 000	EUR	727 649	727 604	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Nouvelle-Zélande (suite)					
Chorus Ltd. 0.875% 19 - 12.05.26	327 000	EUR	324 688	328 475	0,02
Chorus Ltd. 1.125% 16 - 18.10.23	300 000	EUR	302 603	306 513	0,01
Fonterra Co-operative Group Ltd. 0.75% 16 - 11.08.24	450 000	EUR	455 301	450 842	0,02
Westpac Securities NZ Ltd. 0.30% 19 - 25.06.24	855 000	EUR	850 902	860 173	0,04
			7 361 249	7 403 581	0,33
Norvège					
DNB Bank ASA 0.05% 19 - 14.11.23	1 456 000	EUR	1 453 417	1 454 151	0,07
DNB Bank ASA 0.05% 19 - 14.11.23	600 000	EUR	593 361	599 238	0,03
DNB Bank ASA 0.25% 19 - 04.09.24	1 030 000	EUR	1 036 599	1 036 726	0,05
DNB Bank ASA 0.60% 18 - 25.09.23	300 000	EUR	303 404	305 481	0,01
DNB Bank ASA 1.125% 16 - 03.01.23	577 000	EUR	595 125	594 350	0,03
DNB Bank ASA FRN 18 - 20.03.28	600 000	EUR	599 987	595 626	0,03
DNB Bank ASA FRN 17 - 03.01.27	700 000	EUR	702 752	699 181	0,03
DNB Bank ASA 4.25% 12 - 18.01.22	725 000	EUR	774 390	772 444	0,03
Norsk Hydro ASA 1.125% 19 - 04.11.25	500 000	EUR	495 359	482 130	0,02
Norsk Hydro ASA 2.00% 19 - 04.11.29	250 000	EUR	243 573	226 195	0,01
Santander Consumer Bank AS 0.125% 19 - 09.11.24	600 000	EUR	584 085	581 874	0,03
Santander Consumer Bank AS 0.125% 20 - 25.02.25	600 000	EUR	579 147	575 970	0,03
Santander Consumer Bank AS 0.75% 18 - 03.01.23	1 000 000	EUR	1 001 821	999 850	0,04
Santander Consumer Bank AS 0.875% 19 - 21.01.22	700 000	EUR	706 134	704 277	0,03
Sparebank 1 Oestlandet 0.25% 19 - 30.09.24	200 000	EUR	200 221	198 870	0,01
Sparebank 1 Oestlandet 0.25% 19 - 30.09.24	200 000	EUR	193 656	198 870	0,01
Sparebank 1 Oestlandet 0.875% 18 - 13.03.23	100 000	EUR	100 819	101 463	0,00
SpareBank 1 SMN 0.125% 19 - 09.11.26	557 000	EUR	531 963	543 933	0,02
SpareBank 1 SMN 0.50% 17 - 03.09.22	900 000	EUR	905 899	901 980	0,04
SpareBank 1 SMN 0.75% 18 - 07.03.23	500 000	EUR	501 630	505 025	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.375% 16 - 02.10.22	492 000	EUR	494 737	492 192	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.625% 19 - 25.03.24	848 000	EUR	843 586	852 325	0,04
Storebrand Livsforsikring AS FRN 13 - 04.04.43	100 000	EUR	116 187	110 034	0,00
			13 557 852	13 532 185	0,60
Pologne					
mBank SA 1.058% 18 - 09.05.22	200 000	EUR	200 050	197 532	0,01
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA 0.75% 17 - 25.07.21	155 000	EUR	155 766	153 985	0,01
Santander Bank Polska SA 0.75% 18 - 20.09.21	100 000	EUR	100 459	100 188	0,00
Santander Bank Polska SA 0.75% 18 - 20.09.21	132 000	EUR	133 037	132 248	0,00
Tauron Polska Energia SA 2.375% 17 - 07.05.27	607 000	EUR	615 512	610 059	0,03
			1 204 824	1 194 012	0,05
Portugal					
Brisa Concessao Rodoviaria SA 2.00% 16 - 22.03.23	200 000	EUR	204 037	205 228	0,01
Brisa Concessao Rodoviaria SA 2.375% 17 - 05.10.27	100 000	EUR	100 174	105 293	0,01
Brisa-Concessao Rodoviaria SA 1.875% 15 - 30.04.25	300 000	EUR	319 618	308 058	0,01
EDP - Energias de Portugal SA 1.625% 20 - 15.04.27	1 200 000	EUR	1 250 956	1 272 924	0,06
Galp Gas Natural Distribuicao SA 1.375% 16 - 19.09.23	600 000	EUR	605 782	609 810	0,03
NOS Sgpps SA 1.125% 18 - 05.02.23	100 000	EUR	99 835	100 962	0,00
			2 580 402	2 602 275	0,12

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Roumanie					
UniCredit Leasing Corp. IFN SA 0.502% 19 - 18.10.22	200 000	EUR	198 680	196 894	0,01
			198 680	196 894	0,01
Singapour					
DBS Group Holdings Ltd. FRN 18 - 04.11.28	355 000	EUR	360 456	359 260	0,02
			360 456	359 260	0,02
Espagne					
Abertis Infraestructuras SA 0.625% 19 - 15.07.25	900 000	EUR	879 950	849 663	0,04
Abertis Infraestructuras SA 1.00% 16 - 27.02.27	400 000	EUR	382 576	371 420	0,02
Abertis Infraestructuras SA 1.125% 19 - 26.03.28	700 000	EUR	686 361	638 729	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.25% 20 - 02.07.28	500 000	EUR	498 982	463 205	0,02
Abertis Infraestructuras SA 1.375% 16 - 20.05.26	1 000 000	EUR	1 001 647	959 950	0,04
Abertis Infraestructuras SA 1.50% 19 - 27.06.24	300 000	EUR	308 551	298 464	0,01
Abertis Infraestructuras SA 1.625% 19 - 15.07.29	600 000	EUR	570 216	559 866	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.875% 19 - 26.03.32	500 000	EUR	502 952	455 730	0,02
Abertis Infraestructuras SA 2.25% 20 - 29.03.29	500 000	EUR	495 996	490 995	0,02
Abertis Infraestructuras SA 2.375% 19 - 27.09.27	1 300 000	EUR	1 350 079	1 307 202	0,06
Abertis Infraestructuras SA 2.50% 14 - 27.02.25	600 000	EUR	622 070	620 196	0,03
Abertis Infraestructuras SA 3.00% 19 - 27.03.31	900 000	EUR	935 033	929 484	0,04
Abertis Infraestructuras SA 3.75% 13 - 20.06.23	800 000	EUR	855 452	851 920	0,04
ACS Servicios Comunicaciones y Energia SL 1.875% 18 - 20.04.26	700 000	EUR	680 247	723 324	0,03
Amadeus Capital Markets SAU 1.625% 15 - 17.11.21	300 000	EUR	300 869	302 442	0,01
Amadeus Capital Markets SAU 1.625% 15 - 17.11.21	200 000	EUR	203 108	201 628	0,01
Amadeus IT Group SA 0.875% 18 - 18.09.23	1 000 000	EUR	992 458	985 150	0,04
Amadeus IT Group SA 1.50% 18 - 18.09.26	400 000	EUR	394 738	400 716	0,02
Amadeus IT Group SA 2.50% 20 - 20.05.24	400 000	EUR	404 665	413 388	0,02
Amadeus IT Group SA 2.875% 20 - 20.05.27	400 000	EUR	406 881	422 364	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 10.02.24	800 000	EUR	790 621	777 456	0,03
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 15.11.26	200 000	EUR	198 986	197 332	0,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 15.11.26	200 000	EUR	199 400	197 332	0,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.50% 20 - 14.01.27	1 600 000	EUR	1 576 030	1 531 008	0,07
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.625% 17 - 17.01.22	400 000	EUR	402 948	402 776	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.625% 17 - 17.01.22	400 000	EUR	404 319	402 776	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 17 - 09.11.22	1 400 000	EUR	1 401 900	1 405 740	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 17 - 09.11.22	400 000	EUR	402 720	401 640	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 20 - 06.04.25	1 200 000	EUR	1 202 751	1 209 228	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.00% 19 - 21.06.26	900 000	EUR	920 264	894 987	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.00% 19 - 21.06.26	200 000	EUR	194 320	198 886	0,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 20 - 16.01.30	1 100 000	EUR	1 067 837	1 032 680	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.125% 19 - 28.02.24	1 000 000	EUR	1 013 860	1 005 330	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.375% 18 - 14.05.25	500 000	EUR	499 455	509 445	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19 - 22.02.29	700 000	EUR	723 790	711 935	0,03
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.50% 17 - 02.10.27	1 000 000	EUR	1 109 222	1 101 530	0,05
Banco de Sabadell SA FRN 19 - 11.07.25	600 000	EUR	584 361	567 990	0,03
Banco de Sabadell SA 0.875% 17 - 03.05.23	900 000	EUR	910 080	880 794	0,04
Banco de Sabadell SA 0.875% 19 - 22.07.25	600 000	EUR	601 669	572 106	0,03
Banco de Sabadell SA 1.125% 19 - 27.03.25	500 000	EUR	462 559	454 075	0,02
Banco de Sabadell SA 1.625% 18 - 03.07.24	700 000	EUR	717 183	694 484	0,03
Banco de Sabadell SA 1.75% 19 - 05.10.24	900 000	EUR	874 500	853 830	0,04
Banco de Sabadell SA FRN 20 - 29.06.23	100 000	EUR	99 971	100 855	0,00
Banco Santander SA 0.25% 19 - 19.06.24	1 400 000	EUR	1 400 970	1 397 340	0,06
Banco Santander SA 0.30% 19 - 10.04.26	1 100 000	EUR	1 099 478	1 096 205	0,05
Banco Santander SA 0.50% 20 - 02.04.27	1 100 000	EUR	1 088 848	1 055 021	0,05
Banco Santander SA 0.50% 20 - 02.04.27	200 000	EUR	187 729	191 822	0,01
Banco Santander SA 1.125% 18 - 17.01.25	1 100 000	EUR	1 121 453	1 114 938	0,05
Banco Santander SA 1.125% 20 - 23.06.27	200 000	EUR	199 892	201 732	0,01
Banco Santander SA 1.375% 15 - 14.12.22	1 200 000	EUR	1 231 137	1 237 476	0,06
Banco Santander SA 1.375% 17 - 02.09.22	1 400 000	EUR	1 422 964	1 417 822	0,06
Banco Santander SA 1.375% 20 - 01.05.26	1 900 000	EUR	1 904 642	1 933 022	0,09
Banco Santander SA 2.125% 18 - 02.08.28	900 000	EUR	924 304	909 540	0,04
Banco Santander SA 2.50% 15 - 18.03.25	800 000	EUR	850 329	834 584	0,04
Banco Santander SA 3.125% 17 - 19.01.27	800 000	EUR	876 671	862 832	0,04
Banco Santander SA 3.25% 16 - 04.04.26	1 100 000	EUR	1 209 515	1 186 977	0,05
Bankia SA 0.75% 19 - 07.09.26	900 000	EUR	888 129	870 624	0,04
Bankia SA 0.875% 19 - 25.03.24	400 000	EUR	406 397	397 516	0,02
Bankia SA 1.00% 19 - 25.06.24	400 000	EUR	385 185	384 516	0,02
Bankia SA 1.125% 19 - 11.12.26	100 000	EUR	99 835	93 157	0,00
Bankia SA 1.125% 19 - 11.12.26	600 000	EUR	565 694	558 942	0,03
Bankinter SA 0.625% 20 - 10.06.27	700 000	EUR	686 258	661 031	0,03
Bankinter SA 0.875% 19 - 03.05.24	200 000	EUR	204 612	202 802	0,01
Bankinter SA 0.875% 19 - 07.08.26	700 000	EUR	702 101	679 623	0,03
Bankinter SA FRN 17 - 04.06.27	1 100 000	EUR	1 103 446	1 101 144	0,05
CaixaBank SA 0.375% 20 - 02.03.25	900 000	EUR	894 297	884 583	0,04
CaixaBank SA 0.625% 19 - 10.01.24	900 000	EUR	883 645	874 854	0,04
CaixaBank SA 0.75% 18 - 18.04.23	800 000	EUR	806 446	803 288	0,04
CaixaBank SA 1.125% 17 - 17.05.24	1 200 000	EUR	1 223 175	1 218 108	0,05
CaixaBank SA 1.125% 17 - 01.12.23	1 300 000	EUR	1 303 712	1 302 405	0,06
CaixaBank SA 1.125% 19 - 27.03.26	1 200 000	EUR	1 213 354	1 219 392	0,05
CaixaBank SA 1.375% 19 - 19.06.26	1 000 000	EUR	992 441	997 480	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
CaixaBank SA 1.75% 18 - 24.10.23	800 000	EUR	818 424	814 392	0,04
CaixaBank SA FRN 18 - 17.04.30	900 000	EUR	907 333	885 609	0,04
CaixaBank SA 2.375% 19 - 02.01.24	500 000	EUR	521 205	519 620	0,02
CaixaBank SA FRN 17 - 14.07.28	1 300 000	EUR	1 318 798	1 317 797	0,06
CaixaBank SA FRN 17 - 15.02.27	1 100 000	EUR	1 117 291	1 123 595	0,05
Criteria Caixa SA 1.375% 19 - 04.10.24	900 000	EUR	910 997	912 240	0,04
Criteria Caixa SA 1.50% 17 - 05.10.23	500 000	EUR	513 646	509 675	0,02
Criteria Caixa SA 1.50% 17 - 05.10.23	200 000	EUR	199 971	203 870	0,01
Criteria Caixa SA 1.625% 15 - 21.04.22	700 000	EUR	716 305	715 869	0,03
Enagas Financiaciones SA 0.75% 16 - 27.10.26	600 000	EUR	603 031	617 838	0,03
Enagas Financiaciones SA 1.00% 15 - 25.03.23	100 000	EUR	102 040	102 238	0,00
Enagas Financiaciones SA 1.25% 15 - 02.06.25	300 000	EUR	308 718	315 474	0,01
Enagas Financiaciones SA 1.375% 16 - 05.05.28	600 000	EUR	632 313	649 920	0,03
Enagas Financiaciones SA 2.50% 14 - 04.11.22	700 000	EUR	731 063	729 414	0,03
FCC Aqualia SA 1.413% 17 - 06.08.22	500 000	EUR	501 534	500 905	0,02
FCC Aqualia SA 2.629% 17 - 06.08.27	629 000	EUR	648 281	655 921	0,03
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SA 0.815% 19 - 12.04.23	600 000	EUR	594 399	596 874	0,03
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SA 1.661% 19 - 12.04.26	500 000	EUR	500 557	498 055	0,02
Ferrovial Emisiones SA 0.375% 16 - 14.09.22	1 000 000	EUR	1 006 423	997 200	0,04
Ferrovial Emisiones SA 1.375% 17 - 31.03.25	300 000	EUR	299 067	307 515	0,01
Ferrovial Emisiones SA 1.382% 20 - 14.05.26	1 000 000	EUR	999 471	1 012 460	0,05
Ferrovial Emisiones SA 2.50% 14 - 15.07.24	300 000	EUR	325 832	321 099	0,01
Iberdrola Finanzas SA 0.875% 20 - 16.06.25	1 200 000	EUR	1 231 779	1 234 740	0,06
Iberdrola Finanzas SA 1.00% 16 - 03.07.24	400 000	EUR	406 290	411 076	0,02
Iberdrola Finanzas SA 1.00% 17 - 03.07.25	800 000	EUR	826 153	828 368	0,04
Iberdrola Finanzas SA 1.25% 17 - 13.09.27	600 000	EUR	625 253	643 104	0,03
Iberdrola Finanzas SA 1.25% 18 - 28.10.26	700 000	EUR	733 671	741 727	0,03
Iberdrola Finanzas SA 1.621% 17 - 29.11.29	400 000	EUR	442 337	444 120	0,02
IE2 Holdco SAU 2.375% 15 - 27.11.23	200 000	EUR	207 434	210 112	0,01
IE2 Holdco SAU 2.875% 16 - 06.01.26	600 000	EUR	666 267	663 192	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.45% 16 - 28.10.24	800 000	EUR	802 778	801 504	0,04
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.625% 17 - 28.11.25	600 000	EUR	634 059	600 624	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.00% 18 - 17.04.26	300 000	EUR	310 174	303 390	0,01
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.00% 18 - 17.04.26	300 000	EUR	325 278	303 390	0,01
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.50% 17 - 28.11.29	100 000	EUR	103 315	101 681	0,00
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.728% 15 - 06.05.23	700 000	EUR	728 642	734 468	0,03
Kutxabank SA 0.50% 19 - 25.09.24	500 000	EUR	492 344	477 300	0,02
Mapfre SA 1.625% 16 - 19.05.26	700 000	EUR	733 473	747 509	0,03
Mapfre SA FRN 18 - 09.07.48	400 000	EUR	444 935	429 020	0,02
Mapfre SA FRN 17 - 31.03.47	800 000	EUR	878 347	867 872	0,04
Merlin Properties Socimi SA 1.75% 17 - 26.05.25	892 000	EUR	906 098	887 210	0,04
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 16 - 11.02.26	775 000	EUR	794 602	761 631	0,03
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 19 - 12.04.34	600 000	EUR	560 265	553 242	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Merlin Properties Socimi SA 2.225% 16 - 25.04.23	850 000	EUR	874 174	859 410	0,04
Merlin Properties Socimi SA 2.375% 16 - 23.05.22	800 000	EUR	825 366	813 808	0,04
Merlin Properties Socimi SA 2.375% 17 - 18.09.29	200 000	EUR	212 186	199 196	0,01
Naturgy Capital Markets SA 1.125% 17 - 04.11.24	1 000 000	EUR	1 027 122	1 029 800	0,05
Naturgy Capital Markets SA 5.125% 09 - 11.02.21	300 000	EUR	319 704	320 724	0,01
NorteGas Energia Distribucion SA 0.918% 17 - 28.09.22	814 000	EUR	815 305	816 507	0,04
NorteGas Energia Distribucion SA 2.065% 17 - 28.09.27	588 000	EUR	613 461	622 804	0,03
Prosegur Cash SA 1.375% 17 - 02.04.26	500 000	EUR	505 723	489 310	0,02
Prosegur Cia de Seguridad SA 1.00% 18 - 02.08.23	800 000	EUR	797 182	799 264	0,04
Red Electrica Corp. SA 0.875% 20 - 14.04.25	600 000	EUR	614 818	622 632	0,03
Red Electrica Financiaciones SAU 0.375% 20 - 24.07.28	800 000	EUR	812 316	806 000	0,04
Red Electrica Financiaciones SAU 1.00% 16 - 21.04.26	300 000	EUR	309 810	315 033	0,01
Red Electrica Financiaciones SAU 1.125% 15 - 24.04.25	200 000	EUR	211 369	210 220	0,01
Red Electrica Financiaciones SAU 1.25% 18 - 13.03.27	300 000	EUR	304 701	319 602	0,01
Red Electrica Financiaciones SAU 2.125% 14 - 07.01.23	400 000	EUR	423 664	425 088	0,02
Red Electrica Financiaciones SAU 3.875% 13 - 25.01.22	400 000	EUR	425 169	423 792	0,02
Santander Consumer Finance SA 0.375% 19 - 27.06.24	900 000	EUR	889 759	889 092	0,04
Santander Consumer Finance SA 0.375% 19 - 27.06.24	300 000	EUR	295 760	296 364	0,01
Santander Consumer Finance SA 0.375% 20 - 17.01.25	1 100 000	EUR	1 093 004	1 083 775	0,05
Santander Consumer Finance SA 0.50% 17 - 10.04.21	500 000	EUR	503 741	501 790	0,02
Santander Consumer Finance SA 0.50% 19 - 14.11.26	300 000	EUR	292 631	294 306	0,01
Santander Consumer Finance SA 0.875% 17 - 24.01.22	900 000	EUR	907 309	905 760	0,04
Santander Consumer Finance SA 0.875% 18 - 30.05.23	400 000	EUR	400 727	403 640	0,02
Santander Consumer Finance SA 1.00% 19 - 27.02.24	500 000	EUR	497 004	506 575	0,02
Santander Consumer Finance SA 1.125% 18 - 10.09.23	800 000	EUR	818 868	813 832	0,04
Telefonica Emisiones SA 0.664% 20 - 02.03.30	700 000	EUR	702 701	679 763	0,03
Telefonica Emisiones SA 0.75% 16 - 13.04.22	1 100 000	EUR	1 108 453	1 112 804	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.069% 19 - 02.05.24	500 000	EUR	506 726	513 780	0,02
Telefonica Emisiones SA 1.069% 19 - 02.05.24	700 000	EUR	718 486	719 292	0,03
Telefonica Emisiones SA 1.201% 20 - 21.08.27	1 100 000	EUR	1 112 547	1 135 398	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.447% 18 - 22.01.27	900 000	EUR	944 851	945 828	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.46% 16 - 13.04.26	1 300 000	EUR	1 349 374	1 364 779	0,06
Telefonica Emisiones SA 1.495% 18 - 09.11.25	900 000	EUR	935 436	945 873	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.528% 17 - 17.01.25	1 100 000	EUR	1 143 601	1 154 043	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.715% 17 - 01.12.28	1 000 000	EUR	1 034 253	1 074 200	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.788% 19 - 03.12.29	1 000 000	EUR	1 047 271	1 073 200	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.807% 20 - 21.05.32	900 000	EUR	922 177	947 439	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.93% 16 - 17.10.31	800 000	EUR	834 530	864 264	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.957% 19 - 07.01.39	483 000	EUR	507 629	507 831	0,02
Telefonica Emisiones SA 2.242% 14 - 27.05.22	900 000	EUR	930 552	935 982	0,04
Telefonica Emisiones SA 2.318% 17 - 17.10.28	600 000	EUR	666 390	676 332	0,03
Telefonica Emisiones SA 2.932% 14 - 17.10.29	500 000	EUR	588 805	590 255	0,03
Telefonica Emisiones SA 2.932% 14 - 17.10.29	300 000	EUR	322 007	354 153	0,02
Telefonica Emisiones SA 3.987% 13 - 23.01.23	1 400 000	EUR	1 524 107	1 537 102	0,07
			113 529 198	112 992 329	5,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Suède					
Akelius Residential Property AB 1.125% 17 - 14.03.24	650 000	EUR	651 927	646 438	0,03
Akelius Residential Property AB 1.50% 16 - 23.01.22	600 000	EUR	609 659	607 860	0,03
Akelius Residential Property AB 1.75% 17 - 02.07.25	400 000	EUR	416 749	404 440	0,02
Alfa Laval Treasury International AB 0.25% 19 - 25.06.24	100 000	EUR	99 902	98 103	0,00
Alfa Laval Treasury International AB 1.375% 14 - 09.12.22	718 000	EUR	731 760	729 316	0,03
Atlas Copco AB 0.625% 16 - 30.08.26	300 000	EUR	298 330	307 416	0,01
Atlas Copco AB 2.50% 13 - 28.02.23	406 000	EUR	435 489	432 171	0,02
Castellum AB 0.75% 19 - 09.04.26	500 000	EUR	500 752	467 700	0,02
Castellum AB 2.125% 18 - 20.11.23	238 000	EUR	248 704	244 616	0,01
Essity AB 0.50% 20 - 02.03.30	204 000	EUR	203 395	197 805	0,01
Essity AB 0.625% 17 - 28.03.22	705 000	EUR	706 412	710 076	0,03
Essity AB 1.125% 15 - 03.05.25	200 000	EUR	201 332	206 942	0,01
Essity AB 1.125% 17 - 27.03.24	600 000	EUR	615 213	617 568	0,03
Essity AB 1.625% 17 - 30.03.27	300 000	EUR	316 564	320 577	0,01
Essity AB 2.50% 13 - 06.09.23	279 000	EUR	300 223	296 892	0,01
Fastighets AB Balder 1.125% 17 - 14.03.22	900 000	EUR	897 732	898 875	0,04
Fastighets AB Balder 1.125% 19 - 29.01.27	250 000	EUR	241 207	234 925	0,01
Fastighets AB Balder 1.25% 20 - 28.01.28	404 000	EUR	386 604	376 811	0,02
Fastighets AB Balder 1.875% 17 - 14.03.25	600 000	EUR	611 965	604 494	0,03
Fastighets AB Balder 1.875% 17 - 23.01.26	592 000	EUR	607 376	590 052	0,03
Heimstaden Bostad AB 1.125% 20 - 21.01.26	540 000	EUR	534 154	525 533	0,02
Heimstaden Bostad AB 1.75% 18 - 12.07.21	100 000	EUR	99 940	100 761	0,00
Heimstaden Bostad AB 2.125% 19 - 09.05.23	1 270 000	EUR	1 302 198	1 299 566	0,06
Hemso Fastighets AB 1.00% 16 - 09.09.26	292 000	EUR	296 365	288 038	0,01
Hemso Fastighets AB 1.75% 17 - 19.06.29	300 000	EUR	287 852	303 771	0,01
Investor AB 1.50% 18 - 09.12.30	400 000	EUR	413 541	430 616	0,02
Investor AB 1.50% 19 - 20.06.39	520 000	EUR	539 979	549 812	0,03
Investor AB 4.50% 11 - 05.12.23	400 000	EUR	449 071	448 972	0,02
Investor AB 4.875% 09 - 18.11.21	290 000	EUR	310 099	309 407	0,01
Lansforsakringar Bank AB 0.125% 20 - 19.02.25	447 000	EUR	444 118	438 820	0,02
Lansforsakringar Bank AB 0.50% 17 - 19.09.22	710 000	EUR	711 789	712 535	0,03
Lansforsakringar Bank AB 0.875% 18 - 25.09.23	200 000	EUR	201 602	203 080	0,01
Molnlycke Holding AB 0.875% 19 - 09.05.29	350 000	EUR	350 627	331 800	0,02
Molnlycke Holding AB 1.75% 15 - 28.02.24	407 000	EUR	420 912	421 554	0,02
Molnlycke Holding AB 1.875% 17 - 28.02.25	500 000	EUR	513 565	519 160	0,02
ORLEN Capital AB 2.50% 16 - 06.07.23	707 000	EUR	737 769	731 915	0,03
Rikshem AB 1.25% 17 - 28.06.24	200 000	EUR	203 331	201 904	0,01
Sagax AB 1.125% 20 - 30.01.27	204 000	EUR	205 190	188 353	0,01
Sagax AB 2.00% 18 - 17.01.24	500 000	EUR	507 398	499 440	0,02
Sagax AB 2.25% 19 - 13.03.25	214 000	EUR	221 415	214 370	0,01
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1.00% 20 - 08.12.27	771 000	EUR	756 705	710 901	0,03
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1.125% 19 - 09.04.26	510 000	EUR	498 207	482 088	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Suède (suite)					
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1.75% 19 - 14.01.25	600 000	EUR	605 159	595 752	0,03
Sandvik AB 3.00% 14 - 18.06.26	100 000	EUR	114 509	111 956	0,01
Scania CV AB 0.125% 20 - 13.02.23	18 000	EUR	18 000	17 387	0,00
Scania CV AB 2.25% 20 - 06.03.25	160 000	EUR	159 308	163 885	0,01
Securitas AB 1.125% 17 - 20.02.24	300 000	EUR	304 395	301 488	0,01
Securitas AB 1.25% 16 - 15.03.22	200 000	EUR	202 089	202 732	0,01
Securitas AB 1.25% 18 - 03.06.25	200 000	EUR	198 114	201 840	0,01
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.05% 19 - 07.01.24	1 390 000	EUR	1 383 341	1 386 692	0,06
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.25% 20 - 19.05.23	1 114 000	EUR	1 114 656	1 120 996	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.30% 17 - 17.02.22	383 000	EUR	385 060	384 854	0,02
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.375% 20 - 02.11.27	995 000	EUR	988 814	983 169	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.50% 18 - 13.03.23	600 000	EUR	608 815	607 770	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.625% 19 - 11.12.29	628 000	EUR	596 631	624 590	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.75% 16 - 24.08.21	700 000	EUR	704 705	706 209	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 16 - 31.10.28	600 000	EUR	593 254	602 538	0,03
SKF AB 0.875% 19 - 15.11.29	230 000	EUR	230 655	227 792	0,01
SKF AB 1.25% 18 - 17.09.25	300 000	EUR	300 000	310 569	0,01
Svenska Handelsbanken AB 0.05% 19 - 09.03.26	380 000	EUR	379 308	371 184	0,02
Svenska Handelsbanken AB 0.05% 19 - 09.03.26	550 000	EUR	539 570	537 240	0,02
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 19 - 18.06.24	1 010 000	EUR	1 009 036	1 014 080	0,05
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 19 - 18.06.24	200 000	EUR	199 470	200 808	0,01
Svenska Handelsbanken AB 0.25% 17 - 28.02.22	920 000	EUR	923 238	924 324	0,04
Svenska Handelsbanken AB 0.375% 18 - 07.03.23	350 000	EUR	347 396	354 260	0,02
Svenska Handelsbanken AB 0.50% 18 - 21.03.23	900 000	EUR	902 309	913 050	0,04
Svenska Handelsbanken AB 0.50% 20 - 18.02.30	995 000	EUR	982 789	976 045	0,04
Svenska Handelsbanken AB 1.00% 20 - 15.04.25	1 697 000	EUR	1 749 875	1 768 087	0,08
Svenska Handelsbanken AB 1.125% 15 - 14.12.22	1 000 000	EUR	1 027 243	1 028 430	0,05
Svenska Handelsbanken AB FRN 18 - 03.02.28	300 000	EUR	303 737	303 480	0,01
Svenska Handelsbanken AB FRN 18 - 03.05.29	550 000	EUR	550 448	565 967	0,03
Svenska Handelsbanken AB 2.625% 12 - 23.08.22	757 000	EUR	799 377	799 377	0,04
Svenska Handelsbanken AB 4.375% 11 - 20.10.21	1 200 000	EUR	1 268 193	1 270 116	0,06
Swedbank AB 0.25% 17 - 11.07.22	500 000	EUR	502 068	501 045	0,02
Swedbank AB 0.25% 19 - 10.09.24	900 000	EUR	887 734	888 849	0,04
Swedbank AB 0.30% 17 - 09.06.22	540 000	EUR	538 645	541 204	0,02
Swedbank AB 0.40% 18 - 29.08.23	300 000	EUR	296 727	302 121	0,01
Swedbank AB 0.75% 20 - 05.05.25	1 397 000	EUR	1 411 386	1 428 209	0,06
Swedbank AB 1.00% 15 - 06.01.22	1 100 000	EUR	1 117 663	1 118 293	0,05
Swedbank AB FRN 17 - 22.11.27	100 000	EUR	98 613	98 768	0,00
Swedbank AB FRN 18 - 18.09.28	292 000	EUR	291 377	291 842	0,01
Swedish Match AB 0.875% 16 - 23.09.24	200 000	EUR	201 498	200 928	0,01
Swedish Match AB 0.875% 20 - 26.02.27	743 000	EUR	709 741	723 548	0,03
Tele2 AB 1.125% 18 - 15.05.24	609 000	EUR	621 378	626 947	0,03
Tele2 AB 2.125% 18 - 15.05.28	306 000	EUR	327 677	332 839	0,02
Telia Co. AB FRN 20 - 05.11.81	547 000	EUR	531 403	515 728	0,02
Telia Co. AB 1.625% 15 - 23.02.35	383 000	EUR	392 501	392 969	0,02
Telia Co. AB 2.125% 19 - 20.02.34	400 000	EUR	416 189	437 388	0,02
Telia Co. AB 3.00% 12 - 09.07.27	500 000	EUR	571 262	583 480	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Suède (suite)					
Telia Co. AB FRN 17 - 04.04.78	1 378 000	EUR	1 394 827	1 403 548	0,06
Telia Co. AB 3.50% 13 - 09.05.33	400 000	EUR	481 252	504 264	0,02
Telia Co. AB 3.625% 12 - 14.02.24	598 000	EUR	675 004	669 646	0,03
Telia Co. AB 3.875% 10 - 10.01.25	510 000	EUR	602 283	597 725	0,03
Telia Co. AB 4.00% 11 - 22.03.22	300 000	EUR	317 061	318 786	0,01
Telia Co. AB 4.75% 09 - 16.11.21	606 000	EUR	645 437	644 796	0,03
Volvo Treasury AB Zero Coupon 20 - 02.11.23	268 000	EUR	268 341	261 978	0,01
Volvo Treasury AB 0.10% 19 - 24.05.22	100 000	EUR	100 310	98 881	0,00
Volvo Treasury AB 1.625% 20 - 26.05.25	807 000	EUR	822 372	829 297	0,04
Volvo Treasury AB FRN 14 - 03.10.78	559 000	EUR	612 773	597 644	0,03
			53 412 138	53 392 863	2,38
Suisse					
Credit Suisse AG 0.45% 20 - 19.05.25	707 000	EUR	708 624	713 101	0,03
Credit Suisse AG 1.00% 16 - 06.07.23	1 386 000	EUR	1 410 095	1 423 076	0,06
Credit Suisse AG 1.375% 14 - 31.01.22	1 533 000	EUR	1 566 990	1 565 285	0,07
Credit Suisse AG 1.50% 16 - 04.10.26	1 260 000	EUR	1 343 523	1 360 069	0,06
Credit Suisse Group AG 0.65% 19 - 09.10.29	780 000	EUR	775 374	756 787	0,04
Credit Suisse Group AG FRN 20 - 14.01.28	1 251 000	EUR	1 244 857	1 215 859	0,06
Credit Suisse Group AG FRN 19 - 24.06.27	1 420 000	EUR	1 420 095	1 418 296	0,06
Credit Suisse Group AG FRN 17 - 17.07.25	1 877 000	EUR	1 887 544	1 914 465	0,09
Credit Suisse Group AG FRN 20 - 04.02.26	1 594 000	EUR	1 731 529	1 765 833	0,08
UBS AG 0.125% 17 - 11.05.21	1 100 000	EUR	1 103 218	1 101 914	0,05
UBS AG 0.25% 18 - 01.10.22	1 000 000	EUR	1 001 711	1 003 040	0,05
UBS AG 0.625% 18 - 23.01.23	1 300 000	EUR	1 313 914	1 317 030	0,06
UBS AG 0.75% 20 - 21.04.23	2 294 000	EUR	2 318 078	2 330 153	0,11
UBS AG 1.25% 14 - 09.03.21	896 000	EUR	908 843	910 005	0,04
UBS AG 1.25% 14 - 09.03.21	300 000	EUR	305 309	304 689	0,01
UBS Group AG FRN 20 - 29.01.26	1 421 000	EUR	1 396 458	1 395 294	0,06
UBS Group AG 1.25% 16 - 09.01.26	1 355 000	EUR	1 404 992	1 406 720	0,06
UBS Group AG FRN 18 - 17.04.25	1 173 000	EUR	1 196 479	1 202 947	0,05
UBS Group AG 1.50% 16 - 30.11.24	1 150 000	EUR	1 184 419	1 187 732	0,05
UBS Group AG 1.75% 15 - 16.11.22	900 000	EUR	928 724	930 132	0,04
UBS Group AG 2.125% 16 - 03.04.24	600 000	EUR	625 976	636 816	0,03
			25 776 752	25 859 243	1,16
Royaume-Uni					
Ancor UK Finance PLC 1.125% 20 - 23.06.27	140 000	EUR	139 181	141 582	0,01
Anglo American Capital PLC 1.625% 17 - 18.09.25	450 000	EUR	461 811	450 905	0,02
Anglo American Capital PLC 1.625% 19 - 03.11.26	857 000	EUR	866 766	850 821	0,04
Anglo American Capital PLC 3.25% 14 - 04.03.23	622 000	EUR	653 787	656 148	0,03
Anglo American Capital PLC 3.50% 12 - 28.03.22	571 000	EUR	601 657	596 118	0,03
Annington Funding PLC 1.65% 17 - 07.12.24	471 000	EUR	489 415	482 808	0,02
AstraZeneca PLC 0.75% 16 - 05.12.24	500 000	EUR	503 682	511 625	0,02
AstraZeneca PLC 0.875% 14 - 24.11.21	900 000	EUR	911 532	910 719	0,04
AstraZeneca PLC 1.25% 16 - 05.12.28	750 000	EUR	787 028	803 842	0,04
Aviva PLC 0.625% 16 - 27.10.23	405 000	EUR	407 753	409 706	0,02
Aviva PLC 1.875% 18 - 13.11.27	700 000	EUR	750 073	757 561	0,03
Aviva PLC FRN 15 - 12.04.45	800 000	EUR	846 670	850 480	0,04
Aviva PLC FRN 14 - 07.03.44	700 000	EUR	752 313	747 572	0,03
Aviva PLC FRN 13 - 07.05.43	480 000	EUR	556 369	542 405	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Babcock International Group PLC 1.375% 19 - 13.09.27	621 000	EUR	611 320	593 452	0,03
Babcock International Group PLC 1.75% 14 - 10.06.22	800 000	EUR	812 122	808 920	0,04
Barclays Bank PLC 2.25% 14 - 06.10.24	100 000	EUR	107 079	109 033	0,00
Barclays Bank PLC 6.625% 11 - 30.03.22	1 014 000	EUR	1 116 219	1 105 554	0,05
Barclays PLC FRN 17 - 14.11.23	791 000	EUR	786 629	787 369	0,04
Barclays PLC FRN 19 - 06.09.25	540 000	EUR	533 038	528 401	0,02
Barclays PLC FRN 18 - 24.01.26	900 000	EUR	899 040	906 480	0,04
Barclays PLC 1.50% 14 - 04.01.22	516 000	EUR	527 693	522 837	0,02
Barclays PLC 1.50% 18 - 09.03.23	1 080 000	EUR	1 076 146	1 104 721	0,05
Barclays PLC 1.875% 16 - 12.08.23	1 100 000	EUR	1 122 977	1 136 674	0,05
Barclays PLC FRN 17 - 02.07.28	1 431 000	EUR	1 423 432	1 404 112	0,06
Barclays PLC FRN 20 - 04.02.25	2 016 000	EUR	2 073 931	2 165 970	0,10
BAT International Finance PLC 0.875% 15 - 13.10.23	800 000	EUR	807 119	803 848	0,04
BAT International Finance PLC 1.00% 15 - 23.05.22	504 000	EUR	511 614	507 704	0,02
BAT International Finance PLC 1.25% 15 - 13.03.27	850 000	EUR	852 939	838 355	0,04
BAT International Finance PLC 2.00% 15 - 13.03.45	400 000	EUR	362 342	358 192	0,02
BAT International Finance PLC 2.25% 17 - 16.01.30	1 023 000	EUR	1 048 852	1 061 209	0,05
BAT International Finance PLC 2.375% 12 - 19.01.23	600 000	EUR	625 139	626 040	0,03
BAT International Finance PLC 2.75% 13 - 25.03.25	310 000	EUR	327 010	335 516	0,02
BAT International Finance PLC 2.75% 13 - 25.03.25	100 000	EUR	106 399	108 231	0,00
BAT International Finance PLC 3.125% 14 - 03.06.29	609 000	EUR	681 710	678 432	0,03
BAT International Finance PLC 3.625% 11 - 11.09.21	300 000	EUR	313 818	311 907	0,01
BG Energy Capital PLC 1.25% 14 - 21.11.22	900 000	EUR	923 648	915 552	0,04
BG Energy Capital PLC 2.25% 14 - 21.11.29	628 000	EUR	705 786	709 841	0,03
BP Capital Markets PLC 0.83% 16 - 19.09.24	990 000	EUR	1 011 917	1 001 217	0,04
BP Capital Markets PLC 0.831% 19 - 11.08.27	850 000	EUR	873 163	838 023	0,04
BP Capital Markets PLC 0.90% 18 - 07.03.24	1 220 000	EUR	1 231 587	1 236 799	0,06
BP Capital Markets PLC 1.077% 17 - 26.06.25	1 240 000	EUR	1 290 344	1 265 085	0,06
BP Capital Markets PLC 1.104% 19 - 15.11.34	765 000	EUR	741 875	723 835	0,03
BP Capital Markets PLC 1.109% 15 - 16.02.23	846 000	EUR	871 197	865 314	0,04
BP Capital Markets PLC 1.117% 16 - 25.01.24	1 077 000	EUR	1 095 509	1 103 914	0,05
BP Capital Markets PLC 1.231% 19 - 05.08.31	1 000 000	EUR	991 927	988 820	0,04
BP Capital Markets PLC 1.373% 16 - 03.03.22	1 253 000	EUR	1 278 332	1 276 431	0,06
BP Capital Markets PLC 1.373% 16 - 03.03.22	205 000	EUR	208 383	208 834	0,01
BP Capital Markets PLC 1.526% 14 - 26.09.22	966 000	EUR	999 360	994 004	0,04
BP Capital Markets PLC 1.573% 15 - 16.02.27	981 000	EUR	1 026 601	1 021 035	0,05
BP Capital Markets PLC 1.594% 18 - 07.03.28	831 000	EUR	869 750	859 537	0,04
BP Capital Markets PLC 1.637% 17 - 26.06.29	450 000	EUR	461 647	466 403	0,02
BP Capital Markets PLC 1.876% 20 - 04.07.24	997 000	EUR	1 021 856	1 046 661	0,05
BP Capital Markets PLC 1.953% 16 - 03.03.25	300 000	EUR	311 849	318 423	0,01
BP Capital Markets PLC 1.953% 16 - 03.03.25	200 000	EUR	204 854	212 282	0,01
BP Capital Markets PLC 2.177% 14 - 28.09.21	500 000	EUR	513 474	511 965	0,02
BP Capital Markets PLC 2.213% 14 - 25.09.26	551 000	EUR	608 973	597 097	0,03
BP Capital Markets PLC 2.519% 20 - 04.07.28	1 197 000	EUR	1 281 839	1 317 670	0,06
BP Capital Markets PLC 2.822% 20 - 04.07.32	1 297 000	EUR	1 445 516	1 491 018	0,07
BP Capital Markets PLC 2.972% 14 - 27.02.26	500 000	EUR	554 084	560 045	0,03
BP Capital Markets PLC FRN 20 - 31.12.99	230 000	EUR	230 000	231 394	0,01
BP Capital Markets PLC FRN 20 - 31.12.99	160 000	EUR	160 000	161 242	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Brambles Finance PLC 1.50% 17 - 10.04.27	308 000	EUR	329 039	311 733	0,01
British Telecommunications PLC 0.50% 17 - 23.06.22	1 000 000	EUR	1 004 003	1 004 370	0,04
British Telecommunications PLC 0.50% 19 - 09.12.25	630 000	EUR	621 325	624 998	0,03
British Telecommunications PLC 0.875% 18 - 26.09.23	483 000	EUR	491 055	489 347	0,02
British Telecommunications PLC 1.00% 17 - 23.06.24	705 000	EUR	712 514	718 501	0,03
British Telecommunications PLC 1.00% 17 - 21.11.24	1 163 000	EUR	1 171 824	1 180 317	0,05
British Telecommunications PLC 1.125% 16 - 03.10.23	700 000	EUR	711 419	713 839	0,03
British Telecommunications PLC 1.125% 19 - 09.12.29	830 000	EUR	829 620	833 162	0,04
British Telecommunications PLC 1.50% 17 - 23.06.27	966 000	EUR	987 624	1 005 364	0,04
British Telecommunications PLC 1.75% 16 - 03.10.26	700 000	EUR	729 969	740 089	0,03
British Telecommunications PLC 1.75% 16 - 03.10.26	340 000	EUR	354 816	359 472	0,02
British Telecommunications PLC 2.125% 18 - 26.09.28	379 000	EUR	410 943	412 545	0,02
Cadent Finance PLC 0.625% 16 - 22.09.24	398 000	EUR	400 830	402 020	0,02
Cadent Finance PLC 0.75% 20 - 03.11.32	979 000	EUR	927 257	959 205	0,04
Coca-Cola European Partners PLC 0.70% 19 - 09.12.31	500 000	EUR	493 533	486 090	0,02
Coca-Cola European Partners PLC 0.75% 16 - 24.02.22	550 000	EUR	554 113	554 752	0,02
Coca-Cola European Partners PLC 1.125% 16 - 26.05.24	1 176 000	EUR	1 212 974	1 213 902	0,05
Coca-Cola European Partners PLC 1.125% 19 - 04.12.29	400 000	EUR	398 356	412 016	0,02
Coca-Cola European Partners PLC 1.50% 18 - 11.08.27	650 000	EUR	685 986	694 362	0,03
Coca-Cola European Partners PLC 1.75% 16 - 26.05.28	150 000	EUR	161 694	162 606	0,01
Coca-Cola European Partners PLC 1.75% 20 - 27.03.26	555 000	EUR	568 768	589 144	0,03
Coca-Cola European Partners PLC 1.875% 15 - 18.03.30	300 000	EUR	335 633	328 533	0,01
Coca-Cola European Partners PLC 2.375% 13 - 05.07.25	100 000	EUR	110 713	109 477	0,00
Coca-Cola European Partners PLC 2.625% 13 - 11.06.23	400 000	EUR	433 638	430 684	0,02
Compass Group PLC 1.875% 14 - 27.01.23	669 000	EUR	698 549	692 254	0,03
Diageo Finance PLC 0.125% 19 - 10.12.23	909 000	EUR	907 625	908 864	0,04
Diageo Finance PLC 0.25% 18 - 22.10.21	700 000	EUR	700 894	700 770	0,03
Diageo Finance PLC 0.50% 17 - 19.06.24	1 002 000	EUR	1 010 728	1 014 124	0,05
Diageo Finance PLC 1.00% 18 - 22.04.25	950 000	EUR	977 650	985 026	0,04
Diageo Finance PLC 1.50% 18 - 22.10.27	630 000	EUR	645 631	680 646	0,03
Diageo Finance PLC 1.75% 14 - 23.09.24	100 000	EUR	103 872	106 231	0,00
Diageo Finance PLC 1.875% 20 - 27.03.27	568 000	EUR	580 767	623 153	0,03
Diageo Finance PLC 2.375% 14 - 20.05.26	300 000	EUR	333 888	335 274	0,01
Diageo Finance PLC 2.50% 20 - 27.03.32	814 000	EUR	864 643	976 588	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
DS Smith PLC 0.875% 19 - 09.12.26	259 000	EUR	252 835	250 528	0,01
DS Smith PLC 1.375% 17 - 26.07.24	1 200 000	EUR	1 210 098	1 207 848	0,05
DS Smith PLC 2.25% 15 - 16.09.22	953 000	EUR	977 414	977 273	0,04
easyJet PLC 0.875% 19 - 06.11.25	380 000	EUR	356 158	313 508	0,01
easyJet PLC 1.125% 16 - 18.10.23	650 000	EUR	618 466	567 470	0,03
easyJet PLC 1.75% 16 - 02.09.23	427 000	EUR	441 730	382 344	0,02
Experian Finance PLC 1.375% 17 - 25.06.26	500 000	EUR	509 130	512 900	0,02
G4S International Finance PLC 1.50% 16 - 01.09.23	747 000	EUR	732 435	741 278	0,03
G4S International Finance PLC 1.50% 17 - 06.02.24	400 000	EUR	402 600	389 996	0,02
G4S International Finance PLC 1.875% 18 - 24.05.25	521 000	EUR	522 306	507 647	0,02
GlaxoSmithKline Capital PLC Zero Coupon 19 - 23.09.21	300 000	EUR	300 982	299 853	0,01
GlaxoSmithKline Capital PLC Zero Coupon 19 - 23.09.23	700 000	EUR	695 733	697 536	0,03
GlaxoSmithKline Capital PLC 0.125% 20 - 05.12.23	611 000	EUR	609 609	611 281	0,03
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.00% 17 - 09.12.26	760 000	EUR	785 051	796 936	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.25% 18 - 21.05.26	1 200 000	EUR	1 252 397	1 271 112	0,06
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 14 - 12.02.24	800 000	EUR	838 595	843 376	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 17 - 09.12.29	200 000	EUR	214 991	218 414	0,01
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 17 - 09.12.29	250 000	EUR	276 328	273 018	0,01
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.75% 18 - 21.05.30	459 000	EUR	493 877	514 769	0,02
GlaxoSmithKline Capital PLC 4.00% 05 - 16.06.25	700 000	EUR	832 064	832 804	0,04
Hammerson PLC 1.75% 16 - 15.03.23	600 000	EUR	573 509	510 120	0,02
Hammerson PLC 2.00% 14 - 07.01.22	380 000	EUR	346 059	343 908	0,02
HBOS PLC FRN 05 - 18.03.30	200 000	EUR	228 428	216 514	0,01
HBOS PLC FRN 05 - 18.03.30	300 000	EUR	335 314	324 771	0,01
Hitachi Capital UK PLC 0.125% 19 - 29.11.22	720 000	EUR	718 349	701 971	0,03
HSBC Holdings PLC 0.875% 16 - 09.06.24	1 525 000	EUR	1 530 276	1 554 798	0,07
HSBC Holdings PLC 1.50% 16 - 15.03.22	1 947 000	EUR	1 988 536	1 990 146	0,09
HSBC Holdings PLC FRN 18 - 12.04.24	1 100 000	EUR	1 116 492	1 139 446	0,05
HSBC Holdings PLC 2.50% 16 - 15.03.27	1 148 000	EUR	1 269 462	1 307 044	0,06
HSBC Holdings PLC 3.00% 15 - 30.06.25	1 500 000	EUR	1 642 532	1 657 020	0,07
HSBC Holdings PLC 3.125% 16 - 06.07.28	1 000 000	EUR	1 124 262	1 165 370	0,05
Imperial Brands Finance PLC 0.50% 17 - 27.07.21	400 000	EUR	399 847	399 068	0,02
Imperial Brands Finance PLC 1.125% 19 - 14.08.23	1 160 000	EUR	1 160 514	1 170 428	0,05
Imperial Brands Finance PLC 1.375% 17 - 27.01.25	300 000	EUR	301 067	302 736	0,01
Imperial Brands Finance PLC 2.125% 19 - 02.12.27	590 000	EUR	606 183	604 502	0,03
Imperial Brands Finance PLC 3.375% 14 - 26.02.26	500 000	EUR	553 142	550 545	0,02
Informa PLC 1.25% 19 - 22.04.28	550 000	EUR	525 807	500 583	0,02
Informa PLC 1.50% 18 - 07.05.23	700 000	EUR	683 282	687 946	0,03
InterContinental Hotels Group PLC 2.125% 18 - 15.05.27	500 000	EUR	504 516	482 390	0,02
Intermediate Capital Group PLC 1.625% 20 - 17.02.27	347 000	EUR	344 418	313 563	0,01
ITV PLC 1.375% 19 - 26.09.26	650 000	EUR	647 300	626 320	0,03
ITV PLC 2.125% 15 - 21.09.22	800 000	EUR	813 716	816 992	0,04
Leeds Building Society 1.375% 15 - 05.05.22	671 000	EUR	686 657	681 837	0,03
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 0.25% 19 - 10.04.22	800 000	EUR	799 245	794 096	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 0.375% 20 - 28.01.25	610 000	EUR	613 790	600 893	0,03
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 2.375% 20 - 04.09.26	1 208 000	EUR	1 268 456	1 299 808	0,06
Lloyds Bank PLC 1.00% 14 - 19.11.21	1 250 000	EUR	1 264 096	1 269 462	0,06
Lloyds Bank PLC 1.25% 15 - 13.01.25	850 000	EUR	882 615	902 445	0,04
Lloyds Bank PLC 1.375% 15 - 09.08.22	600 000	EUR	615 494	617 874	0,03
Lloyds Banking Group PLC FRN 19 - 11.12.25	1 108 000	EUR	1 065 793	1 083 303	0,05
Lloyds Banking Group PLC FRN 18 - 15.01.24	750 000	EUR	736 043	745 650	0,03
Lloyds Banking Group PLC 1.00% 16 - 11.09.23	600 000	EUR	605 798	605 946	0,03
Lloyds Banking Group PLC 1.50% 17 - 09.12.27	750 000	EUR	784 044	788 272	0,04
Lloyds Banking Group PLC FRN 18 - 09.07.28	800 000	EUR	781 149	797 136	0,04
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 04.01.26	1 337 000	EUR	1 397 349	1 482 425	0,07
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 18.03.30	200 000	EUR	212 157	216 410	0,01
London Stock Exchange Group PLC 0.875% 17 - 19.09.24	400 000	EUR	406 376	410 024	0,02
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 17 - 19.09.29	350 000	EUR	365 626	379 110	0,02
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 18 - 12.06.27	530 000	EUR	549 326	574 154	0,03
Mondi Finance PLC 1.50% 16 - 15.04.24	314 000	EUR	320 212	322 403	0,01
Mondi Finance PLC 1.625% 18 - 27.04.26	800 000	EUR	835 007	834 616	0,04
Motability Operations Group PLC 0.375% 19 - 01.03.26	600 000	EUR	604 214	597 810	0,03
Motability Operations Group PLC 0.875% 17 - 14.03.25	100 000	EUR	99 673	102 791	0,00
Motability Operations Group PLC 1.625% 15 - 06.09.23	662 000	EUR	693 033	692 889	0,03
National Grid Electricity Transmission PLC 0.19% 20 - 20.01.25	340 000	EUR	342 398	340 717	0,02
Nationwide Building Society 0.625% 17 - 19.04.23	800 000	EUR	811 217	811 608	0,04
Nationwide Building Society 1.125% 15 - 06.03.22	500 000	EUR	511 958	509 735	0,02
Nationwide Building Society 1.25% 15 - 03.03.25	300 000	EUR	300 844	317 208	0,01
Nationwide Building Society FRN 18 - 03.08.26	940 000	EUR	967 907	974 489	0,04
Nationwide Building Society FRN 17 - 25.07.29	892 000	EUR	892 072	892 508	0,04
NatWest Markets PLC 0.625% 18 - 03.02.22	1 500 000	EUR	1 507 547	1 494 105	0,07
NatWest Markets PLC 1.00% 19 - 28.05.24	900 000	EUR	910 543	896 355	0,04
NatWest Markets PLC 1.125% 18 - 14.06.23	150 000	EUR	147 994	150 734	0,01
NatWest Markets PLC 2.75% 20 - 04.02.25	1 158 000	EUR	1 182 261	1 240 890	0,06
NGG Finance PLC FRN 19 - 12.05.79	492 000	EUR	481 022	483 390	0,02
NGG Finance PLC FRN 19 - 09.05.82	870 000	EUR	873 224	853 078	0,04
Omnicom Finance Holdings PLC 0.80% 19 - 07.08.27	793 000	EUR	774 611	767 870	0,03
Omnicom Finance Holdings PLC 1.40% 19 - 07.08.31	100 000	EUR	101 543	99 053	0,00
OTE PLC 0.875% 19 - 24.09.26	546 000	EUR	523 160	535 648	0,02
OTE PLC 2.375% 18 - 18.07.22	100 000	EUR	104 624	102 688	0,00
Pearson Funding PLC 1.375% 15 - 05.06.25	452 000	EUR	460 734	452 832	0,02
Phoenix Group Holdings PLC 4.375% 18 - 24.01.29	550 000	EUR	573 121	584 595	0,03
Rentokil Initial PLC 0.875% 19 - 30.05.26	140 000	EUR	141 488	139 209	0,01
Rentokil Initial PLC 0.95% 17 - 22.11.24	514 000	EUR	525 464	516 668	0,02
Rentokil Initial PLC 3.25% 13 - 10.07.21	468 000	EUR	481 777	479 040	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Rio Tinto Finance PLC 2.875% 12 -12.11.24	250 000	EUR	279 417	276 465	0,01
Rolls-Royce PLC 0.875% 18 -05.09.24	647 000	EUR	612 890	585 535	0,03
Rolls-Royce PLC 1.625% 18 -05.09.28	532 000	EUR	533 733	463 728	0,02
Rolls-Royce PLC 2.125% 13 - 18.06.21	100 000	EUR	101 108	99 029	0,00
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 19 - 15.11.25	871 000	EUR	848 543	853 310	0,04
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 18 - 03.02.26	1 480 000	EUR	1 507 971	1 515 698	0,07
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 17 - 03.08.23	1 120 000	EUR	1 139 018	1 139 701	0,05
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 18 - 03.04.25	560 000	EUR	561 732	577 170	0,03
Royal Bank of Scotland Group PLC 2.50% 16 - 22.03.23	1 400 000	EUR	1 476 765	1 457 092	0,07
Royal Mail PLC 1.25% 19 - 10.08.26	421 000	EUR	423 353	404 101	0,02
Royal Mail PLC 2.375% 14 - 29.07.24	907 000	EUR	944 469	947 053	0,04
Santander UK Group Holdings PLC FRN 20 - 28.02.25	1 171 000	EUR	1 132 144	1 137 334	0,05
Santander UK Group Holdings PLC 1.125% 16 - 09.08.23	1 050 000	EUR	1 057 362	1 056 226	0,05
Santander UK PLC 1.125% 15 - 14.01.22	500 000	EUR	508 472	507 235	0,02
Santander UK PLC 1.125% 15 - 03.10.25	400 000	EUR	397 593	417 540	0,02
Sky Ltd. 1.50% 14 - 15.09.21	1 225 000	EUR	1 244 032	1 243 987	0,06
Sky Ltd. 1.875% 14 - 24.11.23	980 000	EUR	1 026 319	1 031 871	0,05
Sky Ltd. 2.25% 15 - 17.11.25	100 000	EUR	108 773	109 965	0,00
Sky Ltd. 2.25% 15 - 17.11.25	300 000	EUR	320 812	329 895	0,01
Sky Ltd. 2.50% 14 - 15.09.26	500 000	EUR	535 149	563 070	0,03
Sky Ltd. 2.50% 14 - 15.09.26	400 000	EUR	447 477	450 456	0,02
Smiths Group PLC 1.25% 15 - 28.04.23	400 000	EUR	410 367	400 184	0,02
Smiths Group PLC 2.00% 17 - 23.02.27	694 000	EUR	716 762	711 697	0,03
SSE PLC 0.875% 17 - 09.06.25	400 000	EUR	411 418	405 276	0,02
SSE PLC 1.25% 20 - 16.04.25	878 000	EUR	900 347	905 859	0,04
SSE PLC 1.375% 18 - 09.04.27	410 000	EUR	424 887	428 393	0,02
SSE PLC 1.75% 15 - 09.08.23	751 000	EUR	783 909	784 299	0,04
SSE PLC 1.75% 20 - 16.04.30	499 000	EUR	523 562	522 443	0,02
SSE PLC 2.375% 13 - 02.10.22	900 000	EUR	933 478	929 196	0,04
SSE PLC FRN 20 - 31.12.99	400 000	EUR	400 000	402 028	0,02
Standard Chartered PLC FRN 17 - 10.03.23	250 000	EUR	248 082	249 685	0,01
Standard Chartered PLC FRN 20 - 27.01.28	610 000	EUR	609 609	601 728	0,03
Standard Chartered PLC FRN 19 - 07.02.27	600 000	EUR	604 653	595 698	0,03
Standard Chartered PLC 1.625% 14 - 13.06.21	200 000	EUR	202 496	202 696	0,01
Standard Chartered PLC FRN 17 - 10.03.27	407 000	EUR	416 576	422 600	0,02
Standard Chartered PLC FRN 20 - 09.09.30	120 000	EUR	119 827	122 086	0,01
Standard Chartered PLC 3.125% 14 - 19.11.24	850 000	EUR	910 411	926 993	0,04
Standard Chartered PLC 3.625% 12 - 23.11.22	800 000	EUR	846 471	857 312	0,04
Swiss Re Finance UK PLC 1.375% 16 - 27.05.23	400 000	EUR	404 191	412 540	0,02
Swiss Re Finance UK PLC FRN 20 - 06.04.52	100 000	EUR	100 000	103 728	0,00
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0.875% 19 - 29.05.26	700 000	EUR	693 365	693 630	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Tesco Corporate Treasury Services PLC 1.375% 18 - 24.10.23	1 200 000	EUR	1 230 077	1 225 080	0,05
Tesco Corporate Treasury Services PLC 2.50% 14 - 07.01.24	474 000	EUR	506 014	504 606	0,02
Tesco PLC 5.125% 07 - 04.10.47	250 000	EUR	365 254	347 843	0,02
Unilever PLC 1.50% 19 - 06.11.39	610 000	EUR	645 894	690 892	0,03
Vodafone Group PLC 0.375% 17 - 22.11.21	940 000	EUR	943 687	943 563	0,04
Vodafone Group PLC 0.50% 16 - 30.01.24	550 000	EUR	554 451	554 092	0,02
Vodafone Group PLC 0.90% 19 - 24.11.26	600 000	EUR	609 036	611 526	0,03
Vodafone Group PLC 1.125% 17 - 20.11.25	200 000	EUR	203 309	207 130	0,01
Vodafone Group PLC 1.125% 17 - 20.11.25	1 100 000	EUR	1 128 283	1 139 215	0,05
Vodafone Group PLC 1.25% 16 - 25.08.21	699 000	EUR	708 304	708 339	0,03
Vodafone Group PLC 1.50% 17 - 24.07.27	500 000	EUR	530 203	529 375	0,02
Vodafone Group PLC 1.60% 16 - 29.07.31	1 016 000	EUR	1 022 397	1 079 429	0,05
Vodafone Group PLC 1.625% 19 - 24.11.30	712 000	EUR	746 536	756 450	0,03
Vodafone Group PLC 1.75% 16 - 25.08.23	1 215 000	EUR	1 264 480	1 271 643	0,06
Vodafone Group PLC 1.875% 14 - 09.11.25	1 353 000	EUR	1 443 334	1 448 129	0,06
Vodafone Group PLC 1.875% 17 - 20.11.29	568 000	EUR	601 674	625 379	0,03
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	1 620 000	EUR	1 747 010	1 781 660	0,08
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	100 000	EUR	103 492	109 979	0,00
Vodafone Group PLC 2.50% 19 - 24.05.39	900 000	EUR	956 956	995 769	0,04
Vodafone Group PLC 2.875% 17 - 20.11.37	600 000	EUR	647 436	696 252	0,03
Vodafone Group PLC 4.65% 10 - 20.01.22	1 257 000	EUR	1 347 731	1 345 719	0,06
Vodafone Group PLC 5.375% 07 - 06.06.22	406 000	EUR	445 891	446 811	0,02
Wellcome Trust Ltd. 1.125% 15 - 21.01.27	300 000	EUR	304 864	309 399	0,01
WPP Finance 2013 3.00% 13 - 20.11.23	1 221 000	EUR	1 316 466	1 300 035	0,06
WPP Finance 2016 1.375% 18 - 20.03.25	600 000	EUR	594 235	595 920	0,03
Yorkshire Building Society 0.875% 18 - 20.03.23	205 000	EUR	205 452	205 373	0,01
Yorkshire Building Society 1.25% 15 - 17.03.22	700 000	EUR	715 137	706 979	0,03
			172 522 587	173 196 113	7,73
États-Unis					
3M Co. 0.375% 16 - 15.02.22	600 000	EUR	603 874	603 654	0,03
3M Co. 0.95% 15 - 15.05.23	400 000	EUR	406 073	411 776	0,02
3M Co. 1.50% 14 - 11.09.26	560 000	EUR	589 631	609 174	0,03
3M Co. 1.50% 16 - 06.02.31	500 000	EUR	531 737	555 540	0,03
3M Co. 1.75% 15 - 15.05.30	406 000	EUR	447 984	458 756	0,02
3M Co. 1.875% 13 - 15.11.21	250 000	EUR	256 282	256 590	0,01
3M Co. 1.875% 13 - 15.11.21	200 000	EUR	205 869	205 272	0,01
AbbVie Inc. 0.75% 19 - 18.11.27	900 000	EUR	899 822	900 333	0,04
AbbVie Inc. 1.25% 19 - 18.11.31	700 000	EUR	709 536	721 385	0,03
AbbVie Inc. 1.375% 16 - 17.05.24	1 110 000	EUR	1 143 246	1 144 232	0,05
AbbVie Inc. 2.125% 16 - 17.11.28	100 000	EUR	104 589	110 767	0,01
AbbVie Inc. 2.125% 16 - 17.11.28	468 000	EUR	518 690	518 390	0,02
Air Products & Chemicals Inc. 0.50% 20 - 05.05.28	807 000	EUR	807 442	811 632	0,04
Air Products & Chemicals Inc. 0.80% 20 - 05.05.32	700 000	EUR	703 862	704 753	0,03
Air Products & Chemicals Inc. 1.00% 15 - 02.12.25	100 000	EUR	101 073	103 772	0,00
Air Products & Chemicals Inc. 1.00% 15 - 02.12.25	100 000	EUR	100 784	103 772	0,00
Albemarle Corp. 1.875% 14 - 12.08.21	300 000	EUR	306 648	299 892	0,01
Altria Group Inc. 1.00% 19 - 15.02.23	700 000	EUR	709 608	706 426	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Altria Group Inc. 1.70% 19 - 15.06.25	480 000	EUR	492 525	493 133	0,02
Altria Group Inc. 1.70% 19 - 15.06.25	108 000	EUR	113 422	110 955	0,01
Altria Group Inc. 2.20% 19 - 15.06.27	1 370 000	EUR	1 424 900	1 441 596	0,06
Altria Group Inc. 3.125% 19 - 15.06.31	1 107 000	EUR	1 188 198	1 206 486	0,05
American Express Credit Corp. 0.625% 16 - 22.11.21	1 150 000	EUR	1 157 200	1 156 957	0,05
American Honda Finance Corp. 0.35% 19 - 26.08.22	763 000	EUR	767 029	760 329	0,03
American Honda Finance Corp. 0.55% 18 - 17.03.23	400 000	EUR	397 090	400 216	0,02
American Honda Finance Corp. 0.55% 18 - 17.03.23	400 000	EUR	403 619	400 216	0,02
American Honda Finance Corp. 0.75% 17 - 17.01.24	100 000	EUR	102 327	100 730	0,00
American Honda Finance Corp. 1.375% 15 - 11.10.22	588 000	EUR	604 653	599 772	0,03
American Honda Finance Corp. 1.60% 20 - 20.04.22	399 000	EUR	401 994	407 112	0,02
American Honda Finance Corp. 1.95% 20 - 18.10.24	997 000	EUR	1 029 307	1 051 925	0,05
American International Group Inc. 1.50% 16 - 06.08.23	500 000	EUR	514 794	515 300	0,02
American International Group Inc. 1.875% 17 - 21.06.27	1 000 000	EUR	1 031 179	1 050 870	0,05
American Tower Corp. 1.375% 17 - 04.04.25	400 000	EUR	397 808	412 348	0,02
American Tower Corp. 1.95% 18 - 22.05.26	406 000	EUR	436 875	431 310	0,02
Amgen Inc. 1.25% 16 - 25.02.22	861 000	EUR	874 624	874 647	0,04
Amgen Inc. 1.25% 16 - 25.02.22	400 000	EUR	407 210	406 340	0,02
Amgen Inc. 2.00% 16 - 25.02.26	409 000	EUR	430 939	445 389	0,02
Apple Inc. 0.50% 19 - 15.11.25	928 000	EUR	928 862	927 230	0,04
Apple Inc. 0.50% 19 - 15.11.31	828 000	EUR	823 131	845 529	0,04
Apple Inc. 0.875% 17 - 24.05.25	1 407 000	EUR	1 459 610	1 471 792	0,07
Apple Inc. 1.00% 14 - 11.10.22	900 000	EUR	921 323	924 480	0,04
Apple Inc. 1.00% 14 - 11.10.22	300 000	EUR	304 882	308 160	0,01
Apple Inc. 1.375% 15 - 17.01.24	814 000	EUR	850 787	857 980	0,04
Apple Inc. 1.375% 17 - 24.05.29	1 050 000	EUR	1 103 813	1 155 357	0,05
Apple Inc. 1.625% 14 - 11.10.26	1 153 000	EUR	1 215 149	1 266 282	0,06
Apple Inc. 2.00% 15 - 17.09.27	700 000	EUR	782 355	794 458	0,04
Apple Inc. 2.00% 15 - 17.09.27	512 000	EUR	585 563	581 089	0,03
Archer-Daniels-Midland Co. 1.00% 18 - 09.12.25	510 000	EUR	514 777	525 014	0,02
Archer-Daniels-Midland Co. 1.75% 15 - 23.06.23	400 000	EUR	419 493	418 604	0,02
AT&T Inc. 0.25% 19 - 03.04.26	170 000	EUR	169 533	163 877	0,01
AT&T Inc. 0.25% 19 - 03.04.26	796 000	EUR	781 934	767 328	0,03
AT&T Inc. 0.80% 19 - 03.04.30	970 000	EUR	943 137	926 156	0,04
AT&T Inc. 1.05% 18 - 09.05.23	500 000	EUR	499 618	505 325	0,02
AT&T Inc. 1.30% 15 - 09.05.23	700 000	EUR	713 136	713 265	0,03
AT&T Inc. 1.45% 14 - 06.01.22	700 000	EUR	711 589	712 187	0,03
AT&T Inc. 1.45% 14 - 06.01.22	418 000	EUR	427 964	425 277	0,02
AT&T Inc. 1.60% 20 - 19.05.28	1 525 000	EUR	1 549 319	1 563 720	0,07
AT&T Inc. 1.80% 18 - 09.05.26	1 323 000	EUR	1 376 785	1 383 421	0,06
AT&T Inc. 1.80% 19 - 14.09.39	180 000	EUR	179 810	168 656	0,01
AT&T Inc. 1.80% 19 - 14.09.39	550 000	EUR	534 183	515 339	0,02
AT&T Inc. 1.95% 18 - 15.09.23	800 000	EUR	843 996	827 592	0,04
AT&T Inc. 1.95% 19 - 15.09.23	200 000	EUR	211 800	206 898	0,01
AT&T Inc. 2.05% 20 - 19.05.32	1 111 000	EUR	1 143 278	1 157 362	0,05
AT&T Inc. 2.35% 18 - 09.05.29	1 364 000	EUR	1 456 246	1 486 665	0,07
AT&T Inc. 2.40% 14 - 15.03.24	1 100 000	EUR	1 179 613	1 165 153	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
AT&T Inc. 2.45% 15 - 15.03.35	331 000	EUR	350 206	352 068	0,02
AT&T Inc. 2.45% 15 - 15.03.35	650 000	EUR	660 822	691 372	0,03
AT&T Inc. 2.50% 13 - 15.03.23	1 450 000	EUR	1 506 269	1 523 558	0,07
AT&T Inc. 2.60% 14 - 17.12.29	750 000	EUR	839 456	838 215	0,04
AT&T Inc. 2.60% 20 - 19.05.38	607 000	EUR	627 566	643 038	0,03
AT&T Inc. 2.65% 13 - 17.12.21	700 000	EUR	722 138	719 754	0,03
AT&T Inc. 2.75% 16 - 19.05.23	400 000	EUR	421 222	425 392	0,02
AT&T Inc. 3.15% 17 - 09.04.36	1 550 000	EUR	1 688 818	1 755 297	0,08
AT&T Inc. 3.375% 14 - 15.03.34	400 000	EUR	463 034	476 296	0,02
AT&T Inc. 3.50% 13 - 17.12.25	552 000	EUR	621 544	629 650	0,03
AT&T Inc. 3.50% 13 - 17.12.25	362 000	EUR	422 994	412 923	0,02
AT&T Inc. 3.55% 12 - 17.12.32	1 100 000	EUR	1 310 693	1 321 034	0,06
Autoliv Inc. 0.75% 18 - 26.06.23	307 000	EUR	306 817	299 021	0,01
Avery Dennison Corp. 1.25% 17 - 03.03.25	100 000	EUR	102 725	101 486	0,00
Avery Dennison Corp. 1.25% 17 - 03.03.25	200 000	EUR	199 829	202 972	0,01
Bank of America Corp. FRN 19 - 08.08.29	785 000	EUR	790 698	759 346	0,03
Bank of America Corp. 0.75% 16 - 26.07.23	1 500 000	EUR	1 516 722	1 515 525	0,07
Bank of America Corp. FRN 19 - 05.09.26	1 650 000	EUR	1 662 593	1 659 355	0,07
Bank of America Corp. 1.375% 14 - 09.10.21	1 550 000	EUR	1 574 089	1 573 374	0,07
Bank of America Corp. 1.375% 15 - 26.03.25	200 000	EUR	205 748	208 666	0,01
Bank of America Corp. FRN 17 - 02.07.25	1 700 000	EUR	1 720 472	1 750 014	0,08
Bank of America Corp. FRN 19 - 05.09.30	1 081 000	EUR	1 118 452	1 114 100	0,05
Bank of America Corp. 1.625% 15 - 14.09.22	1 250 000	EUR	1 291 896	1 286 450	0,06
Bank of America Corp. FRN 18 - 25.04.28	1 490 000	EUR	1 561 684	1 568 925	0,07
Bank of America Corp. FRN 17 - 05.04.27	1 130 000	EUR	1 182 900	1 195 732	0,05
Bank of America Corp. 2.375% 14 - 19.06.24	750 000	EUR	805 830	806 422	0,04
Bank of America Corp. FRN 20 - 31.03.29	1 637 000	EUR	1 839 112	1 957 574	0,09
BAT Capital Corp. 1.125% 17 - 16.11.23	674 000	EUR	669 537	681 077	0,03
Baxter International Inc. 0.40% 19 - 15.05.24	160 000	EUR	159 360	161 070	0,01
Baxter International Inc. 0.40% 19 - 15.05.24	670 000	EUR	667 460	674 482	0,03
Baxter International Inc. 1.30% 17 - 30.05.25	500 000	EUR	516 014	523 395	0,02
Baxter International Inc. 1.30% 19 - 15.05.29	188 000	EUR	197 208	196 415	0,01
Baxter International Inc. 1.30% 19 - 15.05.29	500 000	EUR	522 093	522 380	0,02
Becton Dickinson and Co. 1.00% 16 - 15.12.22	407 000	EUR	411 367	409 055	0,02
Becton Dickinson and Co. 1.401% 18 - 24.05.23	650 000	EUR	655 489	660 231	0,03
Becton Dickinson and Co. 1.90% 16 - 15.12.26	300 000	EUR	303 397	310 959	0,01
Berkshire Hathaway Inc. Zero Coupon 20 - 03.12.25	1 158 000	EUR	1 122 876	1 146 767	0,05
Berkshire Hathaway Inc. 0.625% 17 - 17.01.23	900 000	EUR	911 129	912 789	0,04
Berkshire Hathaway Inc. 0.75% 15 - 16.03.23	200 000	EUR	202 041	203 464	0,01
Berkshire Hathaway Inc. 1.125% 15 - 16.03.27	200 000	EUR	198 760	210 630	0,01
Berkshire Hathaway Inc. 1.125% 15 - 16.03.27	1 300 000	EUR	1 336 687	1 369 095	0,06
Berkshire Hathaway Inc. 1.30% 16 - 15.03.24	900 000	EUR	931 147	937 755	0,04
Berkshire Hathaway Inc. 1.625% 15 - 16.03.35	800 000	EUR	832 175	901 696	0,04
Berkshire Hathaway Inc. 2.15% 16 - 15.03.28	200 000	EUR	228 416	227 204	0,01
Berkshire Hathaway Inc. 2.15% 16 - 15.03.28	300 000	EUR	339 195	340 806	0,02
BlackRock Inc. 1.25% 15 - 05.06.25	700 000	EUR	734 938	739 578	0,03
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 1.00% 16 - 10.05.26	1 200 000	EUR	1 187 475	1 222 116	0,05
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 1.50% 19 - 04.10.29	300 000	EUR	311 622	321 120	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 2.00% 15 - 19.05.25	300 000	EUR	307 275	318 063	0,01
BMW US Capital LLC 0.625% 15 - 20.04.22	850 000	EUR	854 544	857 701	0,04
BMW US Capital LLC 1.00% 15 - 20.04.27	700 000	EUR	722 916	720 461	0,03
BMW US Capital LLC 1.125% 15 - 18.09.21	766 000	EUR	776 008	776 042	0,03
Booking Holdings Inc. 0.80% 17 - 03.10.22	500 000	EUR	504 226	501 730	0,02
Booking Holdings Inc. 1.80% 15 - 03.03.27	758 000	EUR	797 623	786 091	0,04
Booking Holdings Inc. 2.15% 15 - 25.11.22	500 000	EUR	522 933	516 055	0,02
Booking Holdings Inc. 2.15% 15 - 25.11.22	300 000	EUR	314 521	309 633	0,01
Booking Holdings Inc. 2.375% 14 - 23.09.24	1 058 000	EUR	1 117 911	1 124 654	0,05
Borg Warner Inc. 1.80% 15 - 11.07.22	500 000	EUR	518 402	507 735	0,02
Boston Scientific Corp. 0.625% 19 - 12.01.27	789 000	EUR	787 693	779 059	0,04
Bristol-Myers Squibb Co. 1.00% 15 - 15.05.25	300 000	EUR	301 380	315 426	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 1.75% 15 - 15.05.35	500 000	EUR	549 392	568 330	0,03
Brown-Forman Corp. 1.20% 16 - 07.07.26	200 000	EUR	203 353	204 690	0,01
Capital One Financial Corp. 0.80% 19 - 06.12.24	920 000	EUR	920 220	898 555	0,04
Capital One Financial Corp. 1.65% 19 - 06.12.29	400 000	EUR	386 506	402 784	0,02
Capital One Financial Corp. 1.65% 19 - 06.12.29	100 000	EUR	107 082	100 696	0,00
Cargill Inc. 2.50% 14 - 15.02.23	200 000	EUR	210 303	211 996	0,01
Celanese US Holdings LLC 1.125% 16 - 26.09.23	668 000	EUR	662 950	659 730	0,03
Celanese US Holdings LLC 1.25% 17 - 02.11.25	400 000	EUR	396 198	391 752	0,02
Celanese US Holdings LLC 1.25% 17 - 02.11.25	144 000	EUR	147 136	141 031	0,01
Celanese US Holdings LLC 2.125% 18 - 03.01.27	399 000	EUR	410 375	396 442	0,02
Chubb INA Holdings Inc. 0.30% 19 - 15.12.24	300 000	EUR	299 670	296 811	0,01
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.06.27	800 000	EUR	822 410	806 280	0,04
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.12.29	600 000	EUR	587 995	595 962	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 1.40% 19 - 15.06.31	600 000	EUR	624 357	621 066	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 1.55% 18 - 15.03.28	540 000	EUR	555 330	568 858	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 1.55% 18 - 15.03.28	400 000	EUR	431 728	421 376	0,02
Chubb INA Holdings Inc. 2.50% 18 - 15.03.38	768 000	EUR	865 811	883 492	0,04
Citigroup Inc. 0.50% 19 - 29.01.22	1 090 000	EUR	1 096 258	1 095 363	0,05
Citigroup Inc. 0.50% 19 - 29.01.22	7 000	EUR	7 066	7 034	0,00
Citigroup Inc. FRN 19 - 10.08.27	1 850 000	EUR	1 823 210	1 798 274	0,08
Citigroup Inc. 0.75% 16 - 26.10.23	1 250 000	EUR	1 255 189	1 265 725	0,06
Citigroup Inc. 1.25% 19 - 04.10.29	1 100 000	EUR	1 127 263	1 142 218	0,05
Citigroup Inc. FRN 20 - 07.06.26	2 200 000	EUR	2 207 566	2 247 960	0,10
Citigroup Inc. 1.375% 14 - 27.10.21	1 221 000	EUR	1 240 596	1 242 441	0,06
Citigroup Inc. 1.50% 16 - 26.10.28	900 000	EUR	941 146	955 269	0,04
Citigroup Inc. FRN 18 - 24.07.26	1 395 000	EUR	1 407 444	1 442 723	0,06
Citigroup Inc. 1.625% 18 - 21.03.28	700 000	EUR	730 621	753 172	0,03
Citigroup Inc. 1.75% 15 - 28.01.25	1 400 000	EUR	1 473 322	1 480 724	0,07
Citigroup Inc. 2.125% 14 - 09.10.26	605 000	EUR	659 572	660 291	0,03
Citigroup Inc. 2.375% 14 - 22.05.24	900 000	EUR	967 093	966 483	0,04
Citigroup Inc. FRN 05 - 25.02.30	255 000	EUR	299 346	289 331	0,01
Coca-Cola Co. 0.125% 19 - 22.09.22	220 000	EUR	219 824	220 077	0,01
Coca-Cola Co. 0.125% 19 - 22.09.22	800 000	EUR	804 776	800 280	0,04
Coca-Cola Co. 0.50% 17 - 03.08.24	100 000	EUR	100 870	101 448	0,00
Coca-Cola Co. 0.75% 15 - 03.09.23	1 300 000	EUR	1 317 554	1 321 060	0,06

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Coca-Cola Co. 0.75% 19 - 22.09.26	1 180 000	EUR	1 204 664	1 216 084	0,05
Coca-Cola Co. 1.10% 16 - 09.02.36	500 000	EUR	508 588	514 725	0,02
Coca-Cola Co. 1.125% 14 - 22.09.22	300 000	EUR	309 143	306 888	0,01
Coca-Cola Co. 1.125% 14 - 22.09.22	1 000 000	EUR	1 027 328	1 022 960	0,05
Coca-Cola Co. 1.125% 15 - 03.09.27	900 000	EUR	915 386	943 839	0,04
Coca-Cola Co. 1.125% 15 - 03.09.27	360 000	EUR	384 561	377 536	0,02
Coca-Cola Co. 1.25% 19 - 03.08.31	675 000	EUR	699 896	719 779	0,03
Coca-Cola Co. 1.625% 15 - 03.09.35	1 200 000	EUR	1 289 352	1 319 376	0,06
Coca-Cola Co. 1.875% 14 - 22.09.26	1 514 000	EUR	1 646 800	1 666 006	0,07
Colgate-Palmolive Co. Zero Coupon 19 - 11.12.21	214 000	EUR	214 753	213 994	0,01
Colgate-Palmolive Co. 0.50% 19 - 03.06.26	300 000	EUR	298 826	306 687	0,01
Colgate-Palmolive Co. 0.875% 19 - 11.12.39	510 000	EUR	498 701	520 955	0,02
Colgate-Palmolive Co. 1.375% 19 - 03.06.34	345 000	EUR	374 513	387 932	0,02
Comcast Corp. 0.25% 20 - 20.05.27	616 000	EUR	615 976	604 857	0,03
Comcast Corp. 0.75% 20 - 20.02.32	1 472 000	EUR	1 470 787	1 433 919	0,06
Comcast Corp. 1.25% 20 - 20.02.40	816 000	EUR	808 996	790 524	0,04
CyrusOne LP Via CyrusOne Finance Corp. 1.45% 20 - 22.01.27	400 000	EUR	393 669	384 744	0,02
Danaher Corp. 1.70% 20 - 30.03.24	768 000	EUR	779 310	804 173	0,04
Danaher Corp. 2.10% 20 - 30.09.26	638 000	EUR	666 178	691 547	0,03
Danaher Corp. 2.50% 20 - 30.03.30	779 000	EUR	847 650	893 108	0,04
Digital Euro Finco LLC 1.125% 19 - 04.09.28	500 000	EUR	480 442	500 925	0,02
Digital Euro Finco LLC 2.50% 19 - 16.01.26	840 000	EUR	883 089	908 292	0,04
Digital Euro Finco LLC 2.625% 16 - 15.04.24	300 000	EUR	312 029	320 391	0,01
Discovery Communications LLC 1.90% 15 - 19.03.27	889 000	EUR	899 164	906 718	0,04
Discovery Communications LLC 2.375% 14 - 03.07.22	200 000	EUR	205 144	204 068	0,01
Dover Corp. 0.75% 19 - 11.04.27	365 000	EUR	364 730	347 429	0,02
Dover Corp. 1.25% 16 - 11.09.26	78 000	EUR	77 549	78 189	0,00
Dover Corp. 1.25% 16 - 11.09.26	500 000	EUR	505 002	501 210	0,02
Dow Chemical Co. 0.50% 20 - 15.03.27	1 495 000	EUR	1 451 793	1 415 900	0,06
Dow Chemical Co. 1.125% 20 - 15.03.32	571 000	EUR	560 349	521 249	0,02
Dow Chemical Co. 1.875% 20 - 15.03.40	347 000	EUR	342 800	320 895	0,01
DXC Technology Co. 1.75% 18 - 15.01.26	400 000	EUR	395 917	393 788	0,02
Eastman Chemical Co. 1.50% 16 - 26.05.23	598 000	EUR	613 445	609 314	0,03
Eastman Chemical Co. 1.875% 16 - 23.11.26	300 000	EUR	312 345	307 794	0,01
Ecolab Inc. 1.00% 16 - 15.01.24	340 000	EUR	350 934	349 874	0,02
Ecolab Inc. 2.625% 15 - 07.08.25	100 000	EUR	110 212	110 594	0,01
Ecolab Inc. 2.625% 15 - 07.08.25	300 000	EUR	338 504	331 782	0,02
Eli Lilly & Co. 0.625% 19 - 11.01.31	377 000	EUR	379 448	382 414	0,02
Eli Lilly & Co. 1.00% 15 - 06.02.22	500 000	EUR	507 785	508 175	0,02
Eli Lilly & Co. 1.625% 15 - 06.02.26	800 000	EUR	870 050	870 776	0,04
Eli Lilly & Co. 1.70% 19 - 11.01.49	1 050 000	EUR	1 066 823	1 092 861	0,05
Eli Lilly & Co. 2.125% 15 - 06.03.30	466 000	EUR	508 456	544 241	0,02
Emerson Electric Co. 0.375% 19 - 22.05.24	900 000	EUR	907 555	906 264	0,04
Emerson Electric Co. 1.25% 19 - 15.10.25	809 000	EUR	841 556	851 133	0,04
Emerson Electric Co. 2.00% 19 - 15.10.29	106 000	EUR	120 821	118 734	0,01
Emerson Electric Co. 2.00% 19 - 15.10.29	50 000	EUR	53 310	56 007	0,00
Equinix Inc. 2.875% 17 - 10.01.25	400 000	EUR	405 392	406 492	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Equinix Inc. 2.875% 17 - 02.01.26	812 000	EUR	842 837	826 275	0,04
Equinix Inc. 2.875% 18 - 15.03.24	1 200 000	EUR	1 230 450	1 219 500	0,05
Euronet Worldwide Inc. 1.375% 19 - 22.05.26	850 000	EUR	818 523	797 325	0,04
Expedia Group Inc. 2.50% 15 - 06.03.22	650 000	EUR	634 767	646 815	0,03
Exxon Mobil Corp. 0.142% 20 - 26.06.24	410 000	EUR	410 000	409 988	0,02
Exxon Mobil Corp. 0.524% 20 - 26.06.28	420 000	EUR	420 000	419 710	0,02
Exxon Mobil Corp. 0.835% 20 - 26.06.32	500 000	EUR	500 000	493 625	0,02
Exxon Mobil Corp. 1.408% 20 - 26.06.39	490 000	EUR	490 000	486 403	0,02
FedEx Corp. 0.45% 19 - 08.05.25	400 000	EUR	404 207	388 640	0,02
FedEx Corp. 0.70% 19 - 13.05.22	738 000	EUR	740 332	741 572	0,03
FedEx Corp. 1.00% 16 - 01.11.23	430 000	EUR	436 111	433 530	0,02
FedEx Corp. 1.00% 16 - 01.11.23	100 000	EUR	100 850	100 821	0,00
FedEx Corp. 1.30% 19 - 08.05.31	550 000	EUR	529 923	524 486	0,02
FedEx Corp. 1.625% 16 - 01.11.27	1 215 000	EUR	1 256 047	1 238 644	0,06
Fidelity National Information Services Inc. 0.125% 19 - 12.03.22	1 297 000	EUR	1 285 759	1 290 671	0,06
Fidelity National Information Services Inc. 0.625% 19 - 12.03.25	592 000	EUR	581 383	586 595	0,03
Fidelity National Information Services Inc. 0.75% 19 - 21.05.23	1 227 000	EUR	1 244 722	1 235 736	0,06
Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 19 - 12.03.28	400 000	EUR	397 668	395 628	0,02
Fidelity National Information Services Inc. 1.10% 17 - 15.07.24	650 000	EUR	669 713	663 786	0,03
Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 19 - 21.05.27	1 220 000	EUR	1 264 963	1 261 480	0,06
Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 19 - 21.05.30	985 000	EUR	1 044 900	1 053 881	0,05
Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 19 - 21.05.39	350 000	EUR	394 731	402 385	0,02
Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 19 - 21.05.39	100 000	EUR	118 972	114 967	0,01
Fiserv Inc. 0.375% 19 - 07.01.23	700 000	EUR	697 675	696 871	0,03
Fiserv Inc. 1.125% 19 - 07.01.27	500 000	EUR	512 351	506 055	0,02
Fiserv Inc. 1.625% 19 - 07.01.30	100 000	EUR	102 243	103 445	0,00
Fiserv Inc. 1.625% 19 - 07.01.30	401 000	EUR	421 579	414 814	0,02
Flowserve Corp. 1.25% 15 - 17.03.22	500 000	EUR	485 535	485 840	0,02
Flowserve Corp. 1.25% 15 - 17.03.22	207 000	EUR	207 623	201 138	0,01
Fluor Corp. 1.75% 16 - 21.03.23	300 000	EUR	230 581	223 848	0,01
General Electric Co. 0.375% 17 - 17.05.22	300 000	EUR	295 730	297 201	0,01
General Electric Co. 0.375% 17 - 17.05.22	472 000	EUR	464 776	467 596	0,02
General Electric Co. 0.875% 17 - 17.05.25	1 230 000	EUR	1 215 595	1 186 286	0,05
General Electric Co. 0.875% 17 - 17.05.25	585 000	EUR	582 667	564 209	0,03
General Electric Co. 1.25% 15 - 26.05.23	619 000	EUR	616 031	624 292	0,03
General Electric Co. 1.50% 17 - 17.05.29	2 000 000	EUR	1 904 628	1 885 840	0,08
General Electric Co. 1.875% 15 - 28.05.27	736 000	EUR	761 777	728 404	0,03
General Electric Co. 2.125% 17 - 17.05.37	750 000	EUR	743 331	684 030	0,03
General Electric Co. 4.125% 05 - 19.09.35	100 000	EUR	125 582	112 299	0,01
General Electric Co. 4.125% 05 - 19.09.35	500 000	EUR	576 682	561 495	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
General Mills Inc. 0.45% 20 - 15.01.26	676 000	EUR	670 565	665 745	0,03
General Mills Inc. 1.00% 15 - 27.04.23	300 000	EUR	307 909	303 729	0,01
General Mills Inc. 1.00% 15 - 27.04.23	200 000	EUR	204 063	202 486	0,01
General Mills Inc. 1.50% 15 - 27.04.27	100 000	EUR	99 687	103 397	0,00
General Motors Financial Co. Inc. 0.20% 19 - 09.02.22	740 000	EUR	725 175	710 060	0,03
General Motors Financial Co. Inc. 0.85% 20 - 26.02.26	668 000	EUR	611 136	584 480	0,03
General Motors Financial Co. Inc. 0.955% 16 - 09.07.23	568 000	EUR	576 393	542 548	0,02
General Motors Financial Co. Inc. 1.694% 18 - 26.03.25	400 000	EUR	384 391	372 012	0,02
General Motors Financial Co. Inc. 2.20% 19 - 04.01.24	978 000	EUR	985 525	958 636	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 0.125% 19 - 19.08.24	900 000	EUR	892 857	877 536	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 20 - 21.01.30	928 000	EUR	935 062	908 169	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 20 - 21.01.30	200 000	EUR	187 606	195 726	0,01
Goldman Sachs Group Inc. 1.25% 16 - 05.01.25	1 018 000	EUR	1 007 871	1 031 499	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 1.375% 15 - 26.07.22	997 000	EUR	1 017 973	1 016 661	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 1.375% 17 - 15.05.24	2 111 000	EUR	2 147 525	2 149 864	0,10
Goldman Sachs Group Inc. 1.625% 16 - 27.07.26	1 550 000	EUR	1 604 218	1 619 889	0,07
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 15 - 27.07.23	1 521 000	EUR	1 581 735	1 585 080	0,07
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 22.03.28	672 000	EUR	687 340	724 833	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 11.01.28	1 177 000	EUR	1 249 659	1 273 349	0,06
Goldman Sachs Group Inc. 2.125% 14 - 30.09.24	900 000	EUR	951 590	949 410	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 2.50% 14 - 18.10.21	915 000	EUR	942 648	942 377	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 2.875% 14 - 06.03.26	634 000	EUR	702 147	705 426	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 3.00% 16 - 02.12.31	873 000	EUR	1 018 261	1 030 917	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 3.25% 13 - 02.01.23	1 050 000	EUR	1 124 202	1 123 909	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 3.375% 20 - 27.03.25	2 216 000	EUR	2 368 338	2 472 369	0,11
Goldman Sachs Group Inc. 4.75% 06 - 10.12.21	700 000	EUR	740 771	735 959	0,03
Harley-Davidson Financial Services Inc. 0.90% 19 - 19.11.24	478 000	EUR	461 754	449 177	0,02
Harley-Davidson Financial Services Inc. 3.875% 20 - 19.05.23	929 000	EUR	947 450	970 972	0,04
Honeywell International Inc. Zero Coupon 20 - 03.10.24	979 000	EUR	947 543	967 487	0,04
Honeywell International Inc. 0.75% 20 - 03.10.32	479 000	EUR	446 935	468 874	0,02
Honeywell International Inc. 1.30% 16 - 22.02.23	1 155 000	EUR	1 188 130	1 186 774	0,05
Honeywell International Inc. 2.25% 16 - 22.02.28	235 000	EUR	267 091	265 515	0,01
Honeywell International Inc. 2.25% 16 - 22.02.28	450 000	EUR	509 236	508 433	0,02
Illinois Tool Works Inc. 0.25% 19 - 12.05.24	59 000	EUR	59 372	59 004	0,00
Illinois Tool Works Inc. 0.25% 19 - 12.05.24	300 000	EUR	302 115	300 021	0,01
Illinois Tool Works Inc. 0.625% 19 - 12.05.27	583 000	EUR	578 515	586 545	0,03
Illinois Tool Works Inc. 1.00% 19 - 06.05.31	490 000	EUR	499 664	503 436	0,02
Illinois Tool Works Inc. 1.25% 15 - 22.05.23	900 000	EUR	928 302	927 936	0,04
Illinois Tool Works Inc. 1.25% 15 - 22.05.23	100 000	EUR	103 646	103 104	0,00
Illinois Tool Works Inc. 1.75% 14 - 20.05.22	500 000	EUR	511 775	513 920	0,02
Illinois Tool Works Inc. 2.125% 15 - 22.05.30	350 000	EUR	386 161	396 718	0,02
Illinois Tool Works Inc. 3.00% 14 - 19.05.34	406 000	EUR	501 998	511 053	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
International Business Machines Corp. 0.30% 20 - 02.11.28	1 463 000	EUR	1 438 508	1 424 508	0,06
International Business Machines Corp. 0.375% 19 - 31.01.23	600 000	EUR	599 001	602 556	0,03
International Business Machines Corp. 0.375% 19 - 31.01.23	1 540 000	EUR	1 547 154	1 546 560	0,07
International Business Machines Corp. 0.50% 16 - 09.07.21	600 000	EUR	602 358	603 150	0,03
International Business Machines Corp. 0.65% 20 - 02.11.32	1 525 000	EUR	1 509 264	1 471 320	0,07
International Business Machines Corp. 0.875% 19 - 31.01.25	420 000	EUR	420 758	430 492	0,02
International Business Machines Corp. 0.875% 19 - 31.01.25	400 000	EUR	404 247	409 992	0,02
International Business Machines Corp. 0.95% 17 - 23.05.25	1 000 000	EUR	1 006 939	1 029 970	0,05
International Business Machines Corp. 1.125% 16 - 09.06.24	150 000	EUR	154 910	155 324	0,01
International Business Machines Corp. 1.125% 16 - 09.06.24	200 000	EUR	209 786	207 098	0,01
International Business Machines Corp. 1.20% 20 - 02.11.40	792 000	EUR	781 100	758 039	0,03
International Business Machines Corp. 1.25% 14 - 26.05.23	915 000	EUR	943 559	942 505	0,04
International Business Machines Corp. 1.25% 19 - 29.01.27	766 000	EUR	797 961	800 240	0,04
International Business Machines Corp. 1.50% 17 - 23.05.29	800 000	EUR	822 839	854 520	0,04
International Business Machines Corp. 1.75% 16 - 03.07.28	400 000	EUR	439 878	432 172	0,02
International Business Machines Corp. 1.75% 16 - 03.07.28	200 000	EUR	214 538	216 086	0,01
International Business Machines Corp. 1.75% 19 - 31.01.31	500 000	EUR	534 642	545 250	0,02
International Business Machines Corp. 1.75% 19 - 31.01.31	881 000	EUR	939 915	960 730	0,04
International Business Machines Corp. 2.875% 13 - 11.07.25	500 000	EUR	573 665	565 020	0,03
International Flavors & Fragrances Inc. 0.50% 18 - 25.09.21	200 000	EUR	200 287	199 634	0,01
International Flavors & Fragrances Inc. 1.75% 16 - 14.03.24	517 000	EUR	534 726	530 111	0,02
International Flavors & Fragrances Inc. 1.80% 18 - 25.09.26	650 000	EUR	669 971	655 466	0,03
Jefferies Group LLC 1.00% 19 - 19.07.24	600 000	EUR	596 980	573 828	0,03
Johnson & Johnson 0.25% 16 - 20.01.22	936 000	EUR	941 059	943 778	0,04
Johnson & Johnson 0.25% 16 - 20.01.22	200 000	EUR	201 574	201 662	0,01
Johnson & Johnson 0.65% 16 - 20.05.24	1 100 000	EUR	1 129 207	1 132 087	0,05
Johnson & Johnson 1.15% 16 - 20.11.28	250 000	EUR	255 360	273 985	0,01

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Johnson & Johnson 1.15% 16 - 20.11.28	300 000	EUR	327 875	328 782	0,02
Johnson & Johnson 1.65% 16 - 20.05.35	549 000	EUR	611 838	645 553	0,03
Johnson & Johnson 1.65% 16 - 20.05.35	700 000	EUR	780 331	823 109	0,04
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 24.02.28	1 418 000	EUR	1 389 617	1 383 259	0,06
JPMorgan Chase & Co. 0.625% 16 - 25.01.24	1 928 000	EUR	1 943 788	1 945 275	0,09
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 25.07.31	920 000	EUR	946 898	917 948	0,04
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 25.07.31	300 000	EUR	310 424	299 331	0,01
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 11.04.32	1 730 000	EUR	1 709 302	1 727 249	0,08
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 03.11.27	2 400 000	EUR	2 435 366	2 451 336	0,11
JPMorgan Chase & Co. 1.375% 14 - 16.09.21	996 000	EUR	1 012 520	1 012 862	0,05
JPMorgan Chase & Co. 1.375% 14 - 16.09.21	200 000	EUR	203 846	203 386	0,01
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 15 - 27.01.25	1 100 000	EUR	1 134 859	1 154 516	0,05
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 15 - 26.10.22	1 393 000	EUR	1 428 424	1 434 330	0,06
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 16 - 29.10.26	1 262 000	EUR	1 319 985	1 346 945	0,06
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 18.05.28	2 114 000	EUR	2 226 665	2 229 192	0,10
JPMorgan Chase & Co. FRN 18 - 06.12.29	1 100 000	EUR	1 185 257	1 201 981	0,05
JPMorgan Chase & Co. 2.75% 12 - 24.08.22	1 623 000	EUR	1 713 109	1 710 480	0,08
JPMorgan Chase & Co. 2.75% 13 - 02.01.23	800 000	EUR	855 808	851 704	0,04
JPMorgan Chase & Co. 2.875% 13 - 24.05.28	830 000	EUR	957 938	980 462	0,04
JPMorgan Chase & Co. 3.00% 14 - 19.02.26	900 000	EUR	993 819	1 027 530	0,05
Kellogg Co. 0.80% 17 - 17.11.22	665 000	EUR	673 153	671 012	0,03
Kellogg Co. 1.00% 16 - 17.05.24	500 000	EUR	497 486	507 375	0,02
Kellogg Co. 1.00% 16 - 17.05.24	100 000	EUR	100 962	101 475	0,00
Kellogg Co. 1.25% 15 - 03.10.25	300 000	EUR	307 172	306 900	0,01
Kimberly-Clark Corp. 0.625% 17 - 09.07.24	200 000	EUR	201 830	204 446	0,01
Kinder Morgan Inc. 1.50% 15 - 16.03.22	782 000	EUR	796 309	789 906	0,04
Kinder Morgan Inc. 2.25% 15 - 16.03.27	292 000	EUR	322 538	310 808	0,01
KKR Group Finance Co. V LLC 1.625% 19 - 22.05.29	529 000	EUR	540 662	535 888	0,02
Liberty Mutual Group Inc. 2.75% 16 - 05.04.26	500 000	EUR	547 910	551 185	0,02
ManpowerGroup Inc. 1.75% 18 - 22.06.26	707 000	EUR	726 664	719 231	0,03
ManpowerGroup Inc. 1.875% 15 - 09.11.22	500 000	EUR	512 699	512 625	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.349% 19 - 21.09.26	657 000	EUR	676 019	687 064	0,03
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.349% 19 - 21.09.26	100 000	EUR	100 931	104 576	0,01
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.979% 19 - 21.03.30	300 000	EUR	319 217	330 243	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.979% 19 - 21.03.30	200 000	EUR	204 051	220 162	0,01
Mastercard Inc. 1.10% 15 - 12.01.22	100 000	EUR	101 586	102 213	0,00
Mastercard Inc. 1.10% 15 - 12.01.22	600 000	EUR	615 513	613 278	0,03
Mastercard Inc. 2.10% 15 - 12.01.27	300 000	EUR	321 498	340 380	0,02
Mastercard Inc. 2.10% 15 - 12.01.27	272 000	EUR	313 721	308 611	0,01
McDonald's Corp. 0.625% 17 - 29.01.24	1 100 000	EUR	1 105 054	1 109 185	0,05
McDonald's Corp. 0.90% 19 - 15.06.26	600 000	EUR	617 449	607 818	0,03
McDonald's Corp. 1.00% 16 - 15.11.23	800 000	EUR	817 047	819 664	0,04
McDonald's Corp. 1.125% 15 - 26.05.22	500 000	EUR	511 623	507 735	0,02
McDonald's Corp. 1.50% 17 - 28.11.29	600 000	EUR	621 898	635 112	0,03
McDonald's Corp. 1.60% 19 - 15.03.31	400 000	EUR	424 514	422 908	0,02
McDonald's Corp. 1.75% 16 - 05.03.28	1 000 000	EUR	1 060 610	1 075 600	0,05
McDonald's Corp. 1.875% 15 - 26.05.27	500 000	EUR	523 697	538 460	0,02
McDonald's Corp. 2.00% 13 - 06.01.23	300 000	EUR	316 954	315 291	0,01
McDonald's Corp. 2.625% 14 - 06.11.29	200 000	EUR	234 596	226 508	0,01
McDonald's Corp. 2.875% 13 - 17.12.25	400 000	EUR	436 346	447 780	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
McKesson Corp. 0.625% 17 - 17.08.21	100 000	EUR	99 968	100 130	0,00
McKesson Corp. 0.625% 17 - 17.08.21	359 000	EUR	360 807	359 467	0,02
McKesson Corp. 1.50% 17 - 17.11.25	100 000	EUR	100 294	102 878	0,00
McKesson Corp. 1.50% 17 - 17.11.25	87 000	EUR	91 633	89 504	0,00
McKesson Corp. 1.50% 17 - 17.11.25	300 000	EUR	304 651	308 634	0,01
McKesson Corp. 1.625% 18 - 30.10.26	257 000	EUR	262 022	265 232	0,01
Merck & Co. Inc. 0.50% 16 - 11.02.24	613 000	EUR	627 629	626 351	0,03
Merck & Co. Inc. 1.125% 14 - 15.10.21	100 000	EUR	101 406	101 176	0,00
Merck & Co. Inc. 1.125% 14 - 15.10.21	200 000	EUR	202 572	202 352	0,01
Merck & Co. Inc. 1.375% 16 - 11.02.36	579 000	EUR	603 057	631 359	0,03
Merck & Co. Inc. 1.875% 14 - 15.10.26	966 000	EUR	1 060 855	1 069 120	0,05
Merck & Co. Inc. 2.50% 14 - 15.10.34	400 000	EUR	484 497	500 260	0,02
Metropolitan Life Global Funding I Zero Coupon 19 - 23.09.22	600 000	EUR	597 956	598 926	0,03
Metropolitan Life Global Funding I 0.375% 19 - 04.09.24	1 020 000	EUR	1 030 118	1 025 365	0,05
Metropolitan Life Global Funding I 0.875% 15 - 20.01.22	1 300 000	EUR	1 312 916	1 316 718	0,06
Metropolitan Life Global Funding I 1.25% 14 - 17.09.21	491 000	EUR	499 421	498 478	0,02
Metropolitan Life Global Funding I 2.375% 13 - 01.11.23	200 000	EUR	212 078	211 344	0,01
Microsoft Corp. 2.125% 13 - 12.06.21	1 080 000	EUR	1 111 555	1 108 685	0,05
Microsoft Corp. 2.625% 13 - 05.02.33	600 000	EUR	748 295	768 324	0,03
Microsoft Corp. 3.125% 13 - 12.06.28	1 425 000	EUR	1 728 753	1 780 509	0,08
MMS USA Investments Inc. 0.625% 19 - 13.06.25	400 000	EUR	394 366	382 504	0,02
MMS USA Investments Inc. 1.25% 19 - 13.06.28	900 000	EUR	905 282	856 710	0,04
MMS USA Investments Inc. 1.75% 19 - 13.06.31	900 000	EUR	865 198	858 978	0,04
Mohawk Industries Inc. 2.00% 15 - 14.01.22	379 000	EUR	387 788	386 546	0,02
Molson Coors Beverage Co. 1.25% 16 - 15.07.24	651 000	EUR	636 960	629 823	0,03
Mondelez International Inc. 1.00% 15 - 03.07.22	550 000	EUR	557 473	556 435	0,03
Mondelez International Inc. 1.625% 15 - 03.08.27	200 000	EUR	199 977	211 254	0,01
Mondelez International Inc. 1.625% 15 - 03.08.27	200 000	EUR	205 394	211 254	0,01
Mondelez International Inc. 1.625% 16 - 20.01.23	700 000	EUR	724 976	723 198	0,03
Mondelez International Inc. 2.375% 15 - 03.06.35	350 000	EUR	399 392	385 249	0,02
Moody's Corp. 0.95% 19 - 25.02.30	671 000	EUR	668 197	686 862	0,03
Moody's Corp. 1.75% 15 - 03.09.27	200 000	EUR	211 366	215 980	0,01
Morgan Stanley FRN 19 - 26.07.24	1 768 000	EUR	1 764 210	1 769 344	0,08
Morgan Stanley 1.00% 16 - 12.02.22	900 000	EUR	917 834	910 557	0,04
Morgan Stanley FRN 17 - 23.10.26	1 114 000	EUR	1 137 564	1 149 024	0,05
Morgan Stanley 1.375% 16 - 27.10.26	1 450 000	EUR	1 497 460	1 516 033	0,07
Morgan Stanley 1.75% 15 - 30.01.25	936 000	EUR	981 138	985 411	0,04
Morgan Stanley 1.75% 16 - 03.11.24	1 313 000	EUR	1 361 048	1 371 534	0,06
Morgan Stanley 1.875% 14 - 30.03.23	1 300 000	EUR	1 350 497	1 349 517	0,06
Morgan Stanley 1.875% 17 - 27.04.27	1 669 000	EUR	1 756 723	1 807 393	0,08
Mylan Inc. 2.125% 18 - 23.05.25	400 000	EUR	403 808	416 076	0,02
Nasdaq Inc. 0.875% 20 - 13.02.30	837 000	EUR	831 170	832 924	0,04
Nasdaq Inc. 1.75% 16 - 19.05.23	950 000	EUR	976 535	986 594	0,04
Nasdaq Inc. 1.75% 19 - 28.03.29	400 000	EUR	407 899	430 188	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
National Grid North America Inc. 0.75% 15 - 02.11.22	900 000	EUR	907 059	905 850	0,04
National Grid North America Inc. 0.75% 18 - 08.08.23	300 000	EUR	301 212	304 224	0,01
National Grid North America Inc. 1.00% 17 - 07.12.24	100 000	EUR	103 440	102 834	0,00
Nestle Holdings Inc. 0.875% 17 - 18.07.25	766 000	EUR	789 025	799 007	0,04
New York Life Global Funding 0.25% 20 - 23.01.27	944 000	EUR	942 297	935 797	0,04
Oracle Corp. 3.125% 13 - 07.10.25	109 000	EUR	125 153	124 826	0,01
Parker Hannifin Corp. 1.125% 17 - 03.01.25	498 000	EUR	506 489	500 126	0,02
PepsiCo Inc. 0.25% 20 - 05.06.24	814 000	EUR	814 057	819 031	0,04
PepsiCo Inc. 0.50% 20 - 05.06.28	1 540 000	EUR	1 541 407	1 552 844	0,07
PepsiCo Inc. 0.75% 19 - 18.03.27	100 000	EUR	102 255	103 613	0,00
PepsiCo Inc. 0.75% 19 - 18.03.27	630 000	EUR	659 527	652 762	0,03
PepsiCo Inc. 0.875% 16 - 18.07.28	300 000	EUR	300 393	313 728	0,01
PepsiCo Inc. 0.875% 19 - 16.10.39	370 000	EUR	365 630	364 010	0,02
PepsiCo Inc. 1.125% 19 - 18.03.31	470 000	EUR	489 043	497 448	0,02
PepsiCo Inc. 2.625% 14 - 28.04.26	100 000	EUR	109 676	114 005	0,01
PerkinElmer Inc. 1.875% 16 - 19.07.26	179 000	EUR	189 681	183 865	0,01
Pfizer Inc. 0.25% 17 - 03.06.22	863 000	EUR	867 297	866 668	0,04
Pfizer Inc. 1.00% 17 - 03.06.27	600 000	EUR	611 006	629 694	0,03
Philip Morris International Inc. 0.125% 19 - 08.03.26	300 000	EUR	291 326	286 929	0,01
Philip Morris International Inc. 0.625% 17 - 11.08.24	800 000	EUR	799 662	803 872	0,04
Philip Morris International Inc. 0.80% 19 - 08.01.31	640 000	EUR	623 621	608 358	0,03
Philip Morris International Inc. 1.45% 19 - 08.01.39	690 000	EUR	645 957	642 556	0,03
Philip Morris International Inc. 1.875% 17 - 11.06.37	500 000	EUR	496 564	500 265	0,02
Philip Morris International Inc. 2.00% 16 - 05.09.36	483 000	EUR	512 692	495 278	0,02
Philip Morris International Inc. 2.75% 13 - 19.03.25	30 000	EUR	31 858	32 912	0,00
Philip Morris International Inc. 2.75% 13 - 19.03.25	100 000	EUR	108 305	109 708	0,01
Philip Morris International Inc. 2.875% 12 - 30.05.24	400 000	EUR	433 332	437 748	0,02
Philip Morris International Inc. 2.875% 14 - 03.03.26	1 179 000	EUR	1 321 000	1 313 807	0,06
Philip Morris International Inc. 2.875% 14 - 14.05.29	200 000	EUR	236 954	232 318	0,01
Philip Morris International Inc. 2.875% 14 - 14.05.29	200 000	EUR	219 029	232 318	0,01
Philip Morris International Inc. 3.125% 13 - 06.03.33	583 000	EUR	692 858	682 168	0,03
PPG Industries Inc. 0.875% 15 - 13.03.22	804 000	EUR	811 915	808 776	0,04
PPG Industries Inc. 0.875% 16 - 11.03.25	771 000	EUR	772 664	783 390	0,04
PPG Industries Inc. 1.40% 15 - 13.03.27	354 000	EUR	361 336	364 220	0,02
Praxair Inc. 1.20% 16 - 02.12.24	893 000	EUR	917 331	931 792	0,04
Praxair Inc. 1.625% 14 - 12.01.25	206 000	EUR	224 628	221 289	0,01
Procter & Gamble Co. 0.50% 17 - 25.10.24	250 000	EUR	254 362	256 825	0,01
Procter & Gamble Co. 0.625% 18 - 30.10.24	1 390 000	EUR	1 425 345	1 433 285	0,06
Procter & Gamble Co. 1.125% 15 - 11.02.23	238 000	EUR	246 070	247 939	0,01
Procter & Gamble Co. 1.125% 15 - 11.02.23	643 000	EUR	673 105	669 852	0,03
Procter & Gamble Co. 1.20% 18 - 30.10.28	620 000	EUR	649 405	678 193	0,03
Procter & Gamble Co. 1.25% 17 - 25.10.29	200 000	EUR	211 901	219 398	0,01
Procter & Gamble Co. 1.875% 18 - 30.10.38	450 000	EUR	501 706	542 146	0,02
Procter & Gamble Co. 2.00% 12 - 16.08.22	1 025 000	EUR	1 064 009	1 070 582	0,05
Procter & Gamble Co. 2.00% 13 - 11.05.21	793 000	EUR	817 066	815 537	0,04
Procter & Gamble Co. 4.875% 07 - 05.11.27	300 000	EUR	393 851	400 107	0,02
Procter & Gamble Co. 4.875% 07 - 05.11.27	657 000	EUR	863 110	876 234	0,04
Prologis Euro Finance LLC 0.25% 19 - 09.10.27	1 161 000	EUR	1 116 572	1 136 038	0,05
Prologis Euro Finance LLC 0.375% 20 - 02.06.28	492 000	EUR	492 610	482 834	0,02
Prologis Euro Finance LLC 0.625% 19 - 09.10.31	479 000	EUR	476 668	461 387	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 20 - 02.06.35	481 000	EUR	478 385	466 661	0,02
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 20 - 02.06.35	100 000	EUR	92 804	97 019	0,00
Prologis Euro Finance LLC 1.50% 19 - 09.10.49	390 000	EUR	376 452	372 532	0,02
Prologis Euro Finance LLC 1.875% 18 - 01.05.29	510 000	EUR	543 590	556 104	0,03
Prologis LP 3.00% 13 - 18.01.22	700 000	EUR	729 092	725 844	0,03
Prologis LP 3.00% 14 - 06.02.26	700 000	EUR	797 282	803 698	0,04
Prologis LP 3.375% 14 - 20.02.24	622 000	EUR	682 014	686 508	0,03
Public Storage 0.875% 20 - 24.01.32	624 000	EUR	610 245	611 595	0,03
PVH Corp. 3.125% 17 - 15.12.27	550 000	EUR	567 187	529 622	0,02
PVH Corp. 3.625% 16 - 15.07.24	433 000	EUR	461 258	441 405	0,02
RELX Capital Inc. 1.30% 15 - 05.12.25	100 000	EUR	101 983	104 223	0,00
RELX Capital Inc. 1.30% 15 - 05.12.25	100 000	EUR	102 206	104 223	0,00
Southern Power Co. 1.00% 16 - 20.06.22	417 000	EUR	422 465	422 021	0,02
Southern Power Co. 1.85% 16 - 20.06.26	300 000	EUR	326 945	323 220	0,01
Southern Power Co. 1.85% 16 - 20.06.26	100 000	EUR	107 591	107 740	0,01
Stryker Corp. 0.25% 19 - 12.03.24	1 284 000	EUR	1 265 443	1 270 300	0,06
Stryker Corp. 0.75% 19 - 03.01.29	694 000	EUR	694 882	683 507	0,03
Stryker Corp. 1.00% 19 - 12.03.31	571 000	EUR	570 443	564 017	0,03
Stryker Corp. 1.125% 18 - 30.11.23	821 000	EUR	837 873	842 650	0,04
Stryker Corp. 2.125% 18 - 30.11.27	609 000	EUR	659 497	667 440	0,03
Stryker Corp. 2.625% 18 - 30.11.30	492 000	EUR	569 342	564 477	0,03
Sysco Corp. 1.25% 16 - 23.06.23	407 000	EUR	402 995	404 306	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.125% 19 - 03.01.25	500 000	EUR	487 779	493 040	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.50% 19 - 03.01.28	550 000	EUR	548 256	539 698	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.75% 16 - 09.12.24	900 000	EUR	898 675	911 637	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.75% 16 - 09.12.24	500 000	EUR	500 984	506 465	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.875% 19 - 10.01.31	1 000 000	EUR	1 000 810	988 360	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.375% 16 - 09.12.28	600 000	EUR	626 438	631 734	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.40% 17 - 23.01.26	400 000	EUR	399 541	417 792	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.40% 17 - 23.01.26	100 000	EUR	106 396	104 448	0,01
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.45% 17 - 16.03.27	700 000	EUR	736 261	734 727	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.50% 19 - 10.01.39	889 000	EUR	891 567	875 621	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.75% 20 - 15.04.27	656 000	EUR	665 416	699 722	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.875% 19 - 10.01.49	766 000	EUR	754 349	732 342	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.875% 19 - 10.01.49	100 000	EUR	97 931	95 606	0,00
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.95% 17 - 24.07.29	400 000	EUR	425 030	439 108	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.00% 14 - 15.04.25	400 000	EUR	425 404	428 492	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.15% 15 - 21.07.22	300 000	EUR	310 995	310 041	0,01
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.375% 20 - 15.04.32	956 000	EUR	1 014 897	1 090 184	0,05
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.875% 17 - 24.07.37	349 000	EUR	399 116	423 962	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.875% 17 - 24.07.37	200 000	EUR	229 079	242 958	0,01
Toyota Motor Credit Corp. Zero Coupon 17 - 21.07.21	100 000	EUR	99 903	99 818	0,00
Toyota Motor Credit Corp. 0.25% 20 - 16.07.26	566 000	EUR	570 495	556 780	0,03
Toyota Motor Credit Corp. 0.625% 17 - 21.11.24	160 000	EUR	159 729	161 904	0,01
Toyota Motor Credit Corp. 0.75% 15 - 21.07.22	766 000	EUR	777 102	773 859	0,03
Toyota Motor Credit Corp. 1.00% 14 - 09.10.21	429 000	EUR	434 094	433 028	0,02
Toyota Motor Credit Corp. 2.375% 13 - 02.01.23	500 000	EUR	532 081	526 685	0,02
United Parcel Service Inc. 0.375% 17 - 15.11.23	400 000	EUR	399 081	402 612	0,02
United Parcel Service Inc. 1.00% 16 - 15.11.28	400 000	EUR	404 822	410 840	0,02
United Parcel Service Inc. 1.50% 17 - 15.11.32	500 000	EUR	538 713	537 750	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
United Parcel Service Inc. 1.625% 15 - 15.11.25	500 000	EUR	528 407	533 535	0,02
United Technologies Corp. 2.15% 18 - 18.05.30	607 000	EUR	666 590	668 167	0,03
US Bancorp 0.85% 17 - 06.07.24	1 191 000	EUR	1 188 412	1 210 020	0,05
Verizon Communications Inc. 0.875% 16 - 04.02.25	716 000	EUR	732 078	730 793	0,03
Verizon Communications Inc. 0.875% 16 - 04.02.25	250 000	EUR	255 815	255 165	0,01
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 04.08.27	1 180 000	EUR	1 187 557	1 196 107	0,05
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 04.08.27	300 000	EUR	300 888	304 095	0,01
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 19.03.32	600 000	EUR	562 996	589 056	0,03
Verizon Communications Inc. 1.25% 19 - 04.08.30	961 000	EUR	989 998	994 693	0,04
Verizon Communications Inc. 1.30% 20 - 18.05.33	1 499 000	EUR	1 530 981	1 530 344	0,07
Verizon Communications Inc. 1.375% 16 - 11.02.28	1 100 000	EUR	1 128 150	1 158 300	0,05
Verizon Communications Inc. 1.375% 16 - 11.02.28	350 000	EUR	372 440	368 550	0,02
Verizon Communications Inc. 1.375% 17 - 27.10.26	1 090 000	EUR	1 130 554	1 140 511	0,05
Verizon Communications Inc. 1.50% 19 - 19.09.39	210 000	EUR	210 888	205 256	0,01
Verizon Communications Inc. 1.50% 19 - 19.09.39	200 000	EUR	199 842	195 482	0,01
Verizon Communications Inc. 1.625% 14 - 03.01.24	1 200 000	EUR	1 263 925	1 261 776	0,06
Verizon Communications Inc. 1.85% 20 - 18.05.40	651 000	EUR	664 011	666 051	0,03
Verizon Communications Inc. 1.875% 17 - 26.10.29	100 000	EUR	101 173	109 420	0,01
Verizon Communications Inc. 1.875% 17 - 26.10.29	650 000	EUR	711 074	711 230	0,03
Verizon Communications Inc. 2.625% 14 - 12.01.31	785 000	EUR	862 521	921 292	0,04
Verizon Communications Inc. 2.875% 17 - 15.01.38	450 000	EUR	533 140	542 389	0,02
Verizon Communications Inc. 2.875% 17 - 15.01.38	800 000	EUR	904 589	964 248	0,04
Verizon Communications Inc. 3.25% 14 - 17.02.26	1 000 000	EUR	1 150 567	1 146 920	0,05
Verizon Communications Inc. 3.25% 14 - 17.02.26	100 000	EUR	108 530	114 692	0,01
VF Corp. 0.25% 20 - 25.02.28	447 000	EUR	447 634	422 549	0,02
VF Corp. 0.625% 16 - 20.09.23	900 000	EUR	905 478	903 870	0,04
VF Corp. 0.625% 16 - 20.09.23	500 000	EUR	500 776	502 150	0,02
VF Corp. 0.625% 20 - 25.02.32	347 000	EUR	329 613	316 592	0,01
Walgreens Boots Alliance Inc. 2.125% 14 - 20.11.26	700 000	EUR	711 536	720 027	0,03
Walgreens Boots Alliance Inc. 2.125% 14 - 20.11.26	288 000	EUR	303 543	296 240	0,01
Walmart Inc. 1.90% 14 - 04.08.22	500 000	EUR	513 406	515 120	0,02
Walmart Inc. 1.90% 14 - 04.08.22	315 000	EUR	326 161	324 526	0,01
Walmart Inc. 2.55% 14 - 04.08.26	592 000	EUR	667 498	674 927	0,03
Walmart Inc. 4.875% 09 - 21.09.29	666 000	EUR	910 321	935 637	0,04
Walmart Inc. 4.875% 09 - 21.09.29	100 000	EUR	142 752	140 486	0,01
Wells Fargo & Co. 0.50% 19 - 26.04.24	740 000	EUR	742 024	735 123	0,03
Wells Fargo & Co. 0.625% 19 - 25.03.30	990 000	EUR	989 555	938 074	0,04
Wells Fargo & Co. 0.625% 20 - 14.08.30	1 014 000	EUR	965 499	959 934	0,04
Wells Fargo & Co. 1.00% 16 - 02.02.27	1 320 000	EUR	1 298 178	1 330 864	0,06
Wells Fargo & Co. 1.00% 16 - 02.02.27	500 000	EUR	521 106	504 115	0,02
Wells Fargo & Co. 1.125% 14 - 29.10.21	950 000	EUR	963 773	963 813	0,04
Wells Fargo & Co. 1.125% 14 - 29.10.21	200 000	EUR	203 228	202 908	0,01
Wells Fargo & Co. FRN 20 - 05.04.25	1 696 000	EUR	1 708 865	1 727 037	0,08
Wells Fargo & Co. 1.375% 16 - 26.10.26	1 700 000	EUR	1 779 779	1 754 077	0,08
Wells Fargo & Co. 1.50% 15 - 09.12.22	1 200 000	EUR	1 234 069	1 227 864	0,06
Wells Fargo & Co. 1.50% 15 - 09.12.22	200 000	EUR	204 229	204 644	0,01
Wells Fargo & Co. 1.50% 17 - 24.05.27	1 500 000	EUR	1 564 122	1 553 925	0,07
Wells Fargo & Co. 1.625% 15 - 06.02.25	1 250 000	EUR	1 326 233	1 305 512	0,06
Wells Fargo & Co. FRN 20 - 05.04.30	1 596 000	EUR	1 627 190	1 659 840	0,07

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Wells Fargo & Co. 2.00% 15 - 27.04.26	756 000	EUR	780 225	808 413	0,04
Wells Fargo & Co. 2.00% 15 - 27.04.26	500 000	EUR	548 817	534 665	0,02
Wells Fargo & Co. 2.125% 14 - 06.04.24	750 000	EUR	772 098	791 497	0,04
Wells Fargo & Co. 2.25% 13 - 05.02.23	950 000	EUR	990 576	996 768	0,04
Wells Fargo & Co. 2.625% 12 - 16.08.22	1 334 000	EUR	1 395 259	1 394 510	0,06
Westlake Chemical Corp. 1.625% 19 - 17.07.29	600 000	EUR	610 209	576 924	0,03
Xylem Inc. 2.25% 16 - 03.11.23	300 000	EUR	310 597	310 965	0,01
Zimmer Biomet Holdings Inc. 1.164% 19 - 15.11.27	414 000	EUR	418 582	403 874	0,02
Zimmer Biomet Holdings Inc. 1.414% 16 - 13.12.22	106 000	EUR	109 673	106 285	0,01
Zimmer Biomet Holdings Inc. 2.425% 16 - 13.12.26	779 000	EUR	797 194	825 405	0,04
			388 978 710	390 767 185	17,44
Total - Obligations			2 219 322 216	2 224 782 066	99,32
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			2 219 322 216	2 224 782 066	99,32
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire^(A)					
Obligations					
États-Unis					
AbbVie Inc. 1.25% 20 - 06.01.24	791 000	EUR	799 158	808 544	0,03
AbbVie Inc. 1.50% 20 - 15.11.23	700 000	EUR	714 304	722 960	0,03
AbbVie Inc. 2.125% 20 - 06.01.29	332 000	EUR	346 593	363 367	0,02
AbbVie Inc. 2.625% 20 - 15.11.28	550 000	EUR	589 968	623 211	0,03
			2 450 023	2 518 082	0,11
Total - Obligations			2 450 023	2 518 082	0,11
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			2 450 023	2 518 082	0,11
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			2 221 772 239	2 227 300 148	99,43
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				2 242 363 033	100,10

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Allemagne					
Bundesobligation Zero Coupon 16 - 10.08.21	4 512 406	EUR	4 548 909	4 549 784	1,68
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 04.08.22	4 226 802	EUR	4 273 040	4 278 401	1,58
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 10.07.22	4 140 042	EUR	4 198 302	4 206 481	1,55
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 14.04.23	3 734 438	EUR	3 790 286	3 810 426	1,41
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 13.10.23	3 986 000	EUR	4 058 268	4 082 225	1,51
Bundesobligation Zero Coupon 19 - 04.05.24	4 766 000	EUR	4 871 406	4 896 708	1,81
Bundesobligation Zero Coupon 19 - 18.10.24	4 670 000	EUR	4 812 710	4 814 988	1,78
Bundesobligation Zero Coupon 20 - 04.11.25	3 419 000	EUR	3 537 496	3 536 272	1,30
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	6 082 339	EUR	6 213 340	6 343 651	2,34
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	5 464 000	EUR	5 722 852	5 738 217	2,12
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	1 672 000	EUR	1 701 822	1 679 579	0,62
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	5 300 000	EUR	5 572 551	5 562 662	2,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	1 546 000	EUR	1 601 665	1 608 082	0,59
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	724 000	EUR	754 220	757 465	0,28
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	6 444 943	EUR	6 715 199	6 848 042	2,53
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	5 289 000	EUR	5 502 303	5 663 170	2,09
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	5 614 000	EUR	5 897 505	6 021 932	2,22
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	5 760 975	EUR	6 026 495	6 091 789	2,25
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	6 288 943	EUR	6 602 870	6 721 905	2,48
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	6 251 339	EUR	6 611 448	6 775 279	2,50
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	5 257 611	EUR	5 585 026	5 719 808	2,11
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 14 - 15.08.24	4 588 802	EUR	4 876 947	4 919 549	1,81
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	5 827 975	EUR	6 263 895	6 348 938	2,34
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	4 693 599	EUR	5 953 017	6 404 484	2,36
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 12 - 09.04.22	4 251 802	EUR	4 448 234	4 458 862	1,64
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 13 - 15.02.23	4 409 802	EUR	4 655 166	4 670 685	1,72
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 13 - 15.05.23	4 734 802	EUR	5 022 058	5 040 969	1,86
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 14 - 15.05.24	4 691 802	EUR	5 059 038	5 102 443	1,88
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 12 - 07.04.22	5 464 579	EUR	5 726 722	5 734 207	2,11
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 14 - 15.02.24	4 818 802	EUR	5 225 645	5 258 226	1,94
Bundesrepublik Deutschland 2.00% 11 - 01.04.22	4 639 007	EUR	4 825 480	4 830 292	1,78
Bundesrepublik Deutschland 2.00% 13 - 15.08.23	4 639 802	EUR	5 020 679	5 040 235	1,86
Bundesrepublik Deutschland 2.25% 11 - 09.04.21	3 352 438	EUR	3 466 850	3 467 231	1,28
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 07.04.44	5 945 339	EUR	8 978 643	9 735 671	3,59
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	6 362 878	EUR	9 831 058	10 684 862	3,94
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 07.04.42	4 067 837	EUR	6 746 657	7 176 994	2,65
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 11 - 07.04.21	4 082 406	EUR	4 243 150	4 242 306	1,56
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 01.04.37	5 736 975	EUR	9 419 343	9 883 241	3,64
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 07.04.39	3 859 074	EUR	6 831 073	7 207 224	2,66
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 07.04.28	2 804 338	EUR	3 919 966	4 031 285	1,49
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 07.04.34	5 122 007	EUR	8 526 932	8 895 454	3,28
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 07.04.40	2 697 000	EUR	5 148 544	5 428 424	2,00

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 07.04.40	1 579 438	EUR	3 065 942	3 179 035	1,17
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 01.04.31	4 485 042	EUR	7 161 822	7 366 576	2,72
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 01.04.28	3 537 376	EUR	5 109 048	5 228 685	1,93
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 94 - 01.04.24	2 583 734	EUR	3 206 569	3 222 717	1,19
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 01.04.30	2 422 971	EUR	3 912 423	4 026 226	1,48
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 07.04.27	2 946 338	EUR	4 364 304	4 452 381	1,64
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 06.11.21	2 889 000	EUR	2 909 645	2 906 811	1,07
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 09.10.21	2 570 000	EUR	2 593 705	2 590 007	0,96
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 12.10.21	3 095 000	EUR	3 125 643	3 125 822	1,15
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 03.11.22	3 014 000	EUR	3 053 545	3 048 450	1,12
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 06.10.22	1 160 000	EUR	1 175 204	1 175 771	0,43
			262 464 660	268 590 929	99,05
Total - Obligations			262 464 660	268 590 929	99,05
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			262 464 660	268 590 929	99,05
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			262 464 660	268 590 929	99,05
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				271 187 416	100,01

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Allemagne					
Bundesobligation Zero Coupon 16 - 10.08.21	671 000	EUR	676 525	676 558	7,23
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 04.08.22	640 000	EUR	647 784	647 813	6,92
Bundesobligation Zero Coupon 17 - 10.07.22	609 000	EUR	619 505	618 773	6,61
Bundesobligation Zero Coupon 18 - 14.04.23	578 000	EUR	590 813	589 761	6,30
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 12 - 09.04.22	640 000	EUR	672 824	671 167	7,17
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 13 - 15.02.23	640 000	EUR	679 644	677 862	7,24
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 13 - 15.05.23	702 000	EUR	746 231	747 393	7,99
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 12 - 07.04.22	827 000	EUR	870 150	867 805	9,27
Bundesrepublik Deutschland 2.00% 11 - 01.04.22	702 000	EUR	730 588	730 946	7,81
Bundesrepublik Deutschland 2.25% 11 - 09.04.21	499 000	EUR	515 739	516 087	5,52
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 11 - 07.04.21	593 000	EUR	616 238	616 227	6,59
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 06.11.21	435 000	EUR	438 192	437 682	4,68
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 09.10.21	406 000	EUR	409 896	409 161	4,37
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 19 - 12.10.21	484 000	EUR	489 012	488 820	5,22
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 03.11.22	437 000	EUR	442 840	441 995	4,72
Bundesschatzanweisungen Zero Coupon 20 - 06.10.22	156 000	EUR	158 012	158 121	1,69
			9 303 993	9 296 171	99,33
Total - Obligations			9 303 993	9 296 171	99,33
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			9 303 993	9 296 171	99,33
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			9 303 993	9 296 171	99,33
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				9 358 584	100,00

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Australie					
APT Pipelines Ltd. 1.375% 15 - 22.03.22	200 000	EUR	204 184	202 568	0,03
APT Pipelines Ltd. 2.00% 15 - 22.03.27	200 000	EUR	211 159	211 420	0,04
APT Pipelines Ltd. 2.00% 20 - 15.07.30	259 000	EUR	266 367	273 033	0,05
Aurizon Network Pty Ltd. 2.00% 14 - 18.09.24	200 000	EUR	210 869	209 824	0,04
Aurizon Network Pty Ltd. 3.125% 16 - 06.01.26	100 000	EUR	108 437	110 271	0,02
AusNet Services Holdings Pty Ltd. 0.625% 20 - 25.08.30	166 000	EUR	166 163	166 727	0,03
AusNet Services Holdings Pty Ltd. 1.50% 15 - 26.02.27	200 000	EUR	211 826	214 612	0,04
AusNet Services Holdings Pty Ltd. 3.00% 14 - 13.02.24	100 000	EUR	108 165	109 705	0,02
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0.625% 18 - 21.02.23	200 000	EUR	203 078	203 330	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0.75% 16 - 29.09.26	300 000	EUR	302 836	312 456	0,05
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 19 - 21.11.29	350 000	EUR	350 069	346 622	0,06
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd. 3.125% 13 - 26.09.23	200 000	EUR	215 451	212 816	0,04
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd. 1.75% 14 - 15.10.24	100 000	EUR	106 160	102 175	0,02
Brambles Finance Ltd. 2.375% 14 - 06.12.24	100 000	EUR	105 406	105 658	0,02
Commonwealth Bank of Australia 0.50% 17 - 07.11.22	380 000	EUR	383 692	384 210	0,06
Commonwealth Bank of Australia 1.125% 18 - 18.01.28	200 000	EUR	203 626	214 734	0,04
Commonwealth Bank of Australia FRN 17 - 10.03.29	293 000	EUR	299 971	302 180	0,05
Commonwealth Bank of Australia FRN 15 - 22.04.27	500 000	EUR	508 087	506 635	0,09
Goodman Australia Finance Pty Ltd. 1.375% 17 - 27.09.25	100 000	EUR	100 397	99 998	0,02
Macquarie Bank Ltd. 1.125% 15 - 20.01.22	250 000	EUR	253 542	253 253	0,04
Macquarie Group Ltd. 0.625% 20 - 02.03.27	137 000	EUR	137 785	133 463	0,02
Macquarie Group Ltd. FRN 18 - 03.05.25	100 000	EUR	98 971	100 393	0,02
National Australia Bank Ltd. 0.25% 19 - 20.05.24	320 000	EUR	317 063	322 173	0,05
National Australia Bank Ltd. 0.35% 17 - 09.07.22	200 000	EUR	201 110	201 782	0,03
National Australia Bank Ltd. 0.625% 16 - 11.10.23	137 000	EUR	139 857	139 729	0,02
National Australia Bank Ltd. 0.625% 17 - 18.09.24	100 000	EUR	100 232	102 315	0,02
National Australia Bank Ltd. 0.625% 18 - 30.08.23	300 000	EUR	304 468	305 877	0,05
National Australia Bank Ltd. 0.875% 15 - 20.01.22	431 000	EUR	437 171	437 293	0,07
National Australia Bank Ltd. 1.125% 19 - 20.05.31	200 000	EUR	208 964	216 440	0,04
National Australia Bank Ltd. 1.25% 16 - 18.05.26	350 000	EUR	365 501	373 065	0,06
National Australia Bank Ltd. 1.375% 18 - 30.08.28	500 000	EUR	528 832	547 255	0,09
National Australia Bank Ltd. 2.75% 12 - 08.08.22	438 000	EUR	462 936	463 816	0,08
Origin Energy Finance Ltd. 1.00% 19 - 17.09.29	200 000	EUR	183 195	188 178	0,03
Origin Energy Finance Ltd. 3.50% 13 - 10.04.21	400 000	EUR	415 712	413 908	0,07
Scentre Group Trust 1 2.25% 14 - 16.07.24	200 000	EUR	208 085	206 200	0,03
Scentre Group Trust 1 Via Scentre Group Trust 2 1.375% 16 - 22.03.23	200 000	EUR	204 787	200 382	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Australie (suite)					
Scentre Group Trust 1 Via Scentre Group Trust 2 1.45% 19 - 28.03.29	200 000	EUR	194 567	190 722	0,03
Scentre Group Trust 1 Via Scentre Group Trust 2 1.75% 18 - 04.11.28	150 000	EUR	159 416	147 765	0,02
Scentre Group Trust 2 3.25% 13 - 09.11.23	100 000	EUR	108 991	105 876	0,02
Stockland Trust 1.50% 14 - 11.03.21	200 000	EUR	200 604	201 024	0,03
Stockland Trust 1.625% 18 - 27.04.26	100 000	EUR	99 134	98 814	0,02
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 18 - 26.04.28	200 000	EUR	208 471	201 128	0,03
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 2.75% 14 - 23.04.24	300 000	EUR	318 482	314 829	0,05
Telstra Corp. Ltd. 1.00% 20 - 23.04.30	233 000	EUR	237 358	239 957	0,04
Telstra Corp. Ltd. 1.125% 16 - 14.04.26	200 000	EUR	208 674	209 060	0,04
Telstra Corp. Ltd. 1.375% 19 - 26.03.29	200 000	EUR	205 112	214 206	0,04
Telstra Corp. Ltd. 2.50% 13 - 15.09.23	450 000	EUR	483 895	482 427	0,08
Telstra Corp. Ltd. 3.50% 12 - 21.09.22	400 000	EUR	430 436	428 864	0,07
Telstra Corp. Ltd. 3.75% 11 - 16.05.22	200 000	EUR	213 616	212 982	0,04
Toyota Finance Australia Ltd. 0.25% 19 - 04.09.24	300 000	EUR	296 272	299 403	0,05
Toyota Finance Australia Ltd. 0.50% 18 - 04.06.23	150 000	EUR	152 006	150 815	0,03
Toyota Finance Australia Ltd. 1.584% 20 - 21.04.22	299 000	EUR	305 056	306 358	0,05
Toyota Finance Australia Ltd. 2.004% 20 - 21.10.24	233 000	EUR	247 342	248 669	0,04
Toyota Finance Australia Ltd. 2.28% 20 - 21.10.27	233 000	EUR	253 637	259 401	0,04
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.45% 19 - 16.05.29	200 000	EUR	206 322	198 536	0,03
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 17 - 29.03.28	200 000	EUR	204 962	204 800	0,03
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.875% 14 - 16.09.24	200 000	EUR	207 202	207 544	0,04
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 2.00% 15 - 28.08.25	100 000	EUR	107 748	104 067	0,02
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 3.00% 20 - 04.08.30	320 000	EUR	346 840	352 614	0,06
Vicinity Centres Trust 1.125% 19 - 11.07.29	200 000	EUR	182 682	184 744	0,03
Wesfarmers Ltd. 1.25% 14 - 10.07.21	150 000	EUR	152 362	151 953	0,03
Wesfarmers Ltd. 2.75% 12 - 08.02.22	315 000	EUR	332 574	330 410	0,06
Westpac Banking Corp. 0.25% 16 - 17.01.22	400 000	EUR	401 825	401 532	0,07
Westpac Banking Corp. 0.375% 17 - 03.05.23	300 000	EUR	302 613	303 189	0,05
Westpac Banking Corp. 0.625% 17 - 22.11.24	250 000	EUR	252 342	255 727	0,04
Westpac Banking Corp. 0.75% 18 - 17.10.23	150 000	EUR	152 520	153 551	0,03
Westpac Banking Corp. 0.875% 16 - 17.04.27	200 000	EUR	208 488	209 796	0,04
Westpac Banking Corp. 1.125% 17 - 09.05.27	200 000	EUR	207 606	213 492	0,04
Westpac Banking Corp. 1.45% 18 - 17.07.28	300 000	EUR	316 247	330 657	0,06
			16 739 556	16 809 408	2,85
Autriche					
CA Immobilien Anlagen AG 0.875% 20 - 02.05.27	200 000	EUR	192 333	188 740	0,03
Erste Group Bank AG 0.375% 19 - 16.04.24	100 000	EUR	100 933	100 474	0,02
Erste Group Bank AG 0.875% 19 - 22.05.26	200 000	EUR	198 015	202 074	0,03
Erste Group Bank AG 0.875% 20 - 13.05.27	400 000	EUR	408 032	411 452	0,07
Erste Group Bank AG FRN 19 - 06.10.30	200 000	EUR	199 387	190 874	0,03
IMMOFINANZ AG 2.625% 19 - 27.01.23	300 000	EUR	301 433	300 816	0,05
OMV AG Zero Coupon 19 - 07.03.25	200 000	EUR	200 228	197 266	0,03
OMV AG Zero Coupon 20 - 16.06.23	110 000	EUR	109 549	109 596	0,02
OMV AG 0.75% 18 - 12.04.23	201 000	EUR	203 054	204 950	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Autriche (suite)					
OMV AG 0.75% 20 - 16.06.30	60 000	EUR	59 697	59 305	0,01
OMV AG 1.00% 17 - 14.12.26	410 000	EUR	419 413	427 273	0,07
OMV AG 1.00% 19 - 07.03.34	138 000	EUR	140 478	135 050	0,02
OMV AG 1.50% 20 - 04.09.24	170 000	EUR	175 186	177 852	0,03
OMV AG 1.875% 18 - 12.04.28	140 000	EUR	147 879	154 042	0,03
OMV AG 2.00% 20 - 04.09.28	293 000	EUR	310 214	324 366	0,06
OMV AG 2.375% 20 - 04.09.32	299 000	EUR	318 215	343 252	0,06
OMV AG 2.625% 12 - 27.09.22	300 000	EUR	317 939	317 223	0,05
OMV AG FRN 18 - 31.12.99	100 000	EUR	94 863	100 405	0,02
OMV AG 3.50% 12 - 27.09.27	200 000	EUR	245 124	242 736	0,04
OMV AG FRN 15 - 29.12.49	300 000	EUR	333 919	312 849	0,05
OMV AG FRN 15 - 29.12.49	100 000	EUR	109 103	104 283	0,02
OMV AG FRN 15 - 29.12.49	240 000	EUR	294 251	281 354	0,05
Raiffeisen Bank International AG 0.25% 18 - 07.05.21	200 000	EUR	200 183	199 978	0,03
Raiffeisen Bank International AG 0.25% 20 - 22.01.25	300 000	EUR	295 831	297 462	0,05
Raiffeisen Bank International AG 0.375% 19 - 25.09.26	200 000	EUR	197 557	198 580	0,03
Raiffeisen Bank International AG 1.00% 18 - 12.04.23	200 000	EUR	201 719	203 484	0,03
Raiffeisen Bank International AG FRN 19 - 03.12.30	200 000	EUR	190 165	189 186	0,03
Raiffeisen Bank International AG FRN 20 - 18.06.32	100 000	EUR	99 434	101 466	0,02
Raiffeisen Bank International AG 6.00% 13 - 16.10.23	100 000	EUR	117 503	111 734	0,02
Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 16 - 12.07.26	200 000	EUR	208 825	215 310	0,04
Telekom Finanzmanagement GmbH 3.125% 13 - 12.03.21	200 000	EUR	208 667	208 696	0,04
Telekom Finanzmanagement GmbH 3.50% 13 - 07.04.23	100 000	EUR	110 336	109 929	0,02
Telekom Finanzmanagement GmbH 4.00% 12 - 04.04.22	437 000	EUR	467 404	465 672	0,08
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 15 - 03.02.46	100 000	EUR	114 799	107 212	0,02
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 13 - 10.09.43	200 000	EUR	223 489	221 554	0,04
			7 515 157	7 516 495	1,27
Belgique					
AG Insurance SA FRN 15 - 30.06.47	100 000	EUR	102 635	106 499	0,02
Ageas SA/NV FRN 19 - 07.02.49	200 000	EUR	217 199	206 840	0,03
Barry Callebaut Services NV 2.375% 16 - 24.05.24	120 000	EUR	121 856	128 070	0,02
Belfius Bank SA Zero Coupon 19 - 28.08.26	300 000	EUR	298 492	290 568	0,05
Belfius Bank SA 0.375% 19 - 13.02.26	100 000	EUR	99 327	97 833	0,02
Belfius Bank SA 0.625% 18 - 30.08.23	100 000	EUR	100 976	101 123	0,02
Belfius Bank SA 0.625% 18 - 30.08.23	200 000	EUR	203 175	202 246	0,03
Belfius Bank SA 0.75% 17 - 09.12.22	400 000	EUR	400 238	401 476	0,07
Belfius Bank SA 1.00% 17 - 26.10.24	200 000	EUR	197 711	203 280	0,03
Belfius Bank SA 3.125% 16 - 05.11.26	200 000	EUR	216 810	220 108	0,04
Elia Group SA/NV 1.50% 18 - 09.05.28	200 000	EUR	207 799	215 564	0,04
Elia Group SA/NV FRN 18 - 31.12.49	300 000	EUR	308 853	304 647	0,05
Elia Transmission Belgium SA 0.875% 20 - 28.04.30	300 000	EUR	302 376	306 414	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Belgique (suite)					
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 15 - 27.05.24	200 000	EUR	207 976	208 588	0,03
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 19 - 14.01.26	200 000	EUR	208 563	210 714	0,04
Elia Transmission Belgium SA 3.00% 14 - 04.07.29	100 000	EUR	121 547	121 631	0,02
Elia Transmission Belgium SA 3.25% 13 - 04.04.28	200 000	EUR	238 998	243 012	0,04
KBC Group NV FRN 19 - 12.03.29	200 000	EUR	198 827	193 250	0,03
KBC Group NV 0.625% 19 - 04.10.25	200 000	EUR	201 803	202 610	0,03
KBC Group NV 0.75% 16 - 18.10.23	300 000	EUR	303 216	304 074	0,05
KBC Group NV 0.75% 17 - 03.01.22	500 000	EUR	504 525	504 575	0,09
KBC Group NV 0.75% 20 - 24.01.30	100 000	EUR	99 725	100 422	0,02
KBC Group NV 0.875% 18 - 27.06.23	100 000	EUR	101 968	101 838	0,02
KBC Group NV 1.125% 19 - 25.01.24	400 000	EUR	409 414	410 704	0,07
KBC Group NV FRN 17 - 18.09.29	300 000	EUR	304 241	305 514	0,05
KBC Group NV FRN 15 - 03.11.27	300 000	EUR	301 516	302 418	0,05
Lonza Finance International NV 1.625% 20 - 21.04.27	233 000	EUR	244 165	246 367	0,04
Solvay SA 0.50% 19 - 09.06.29	100 000	EUR	99 024	94 404	0,02
Solvay SA 0.50% 19 - 09.06.29	100 000	EUR	100 106	94 404	0,02
Solvay SA 1.625% 15 - 12.02.22	300 000	EUR	308 435	308 292	0,05
Solvay SA 2.75% 15 - 12.02.27	200 000	EUR	225 117	224 502	0,04
			6 956 613	6 961 987	1,18
Canada					
Bank of Montreal 0.25% 18 - 17.11.21	174 000	EUR	174 817	174 411	0,03
Bank of Nova Scotia 0.125% 19 - 09.04.26	300 000	EUR	293 723	292 431	0,05
Bank of Nova Scotia 0.375% 17 - 04.06.22	200 000	EUR	201 053	200 596	0,03
Bank of Nova Scotia 0.50% 19 - 30.04.24	300 000	EUR	299 659	300 420	0,05
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.375% 19 - 05.03.24	277 000	EUR	268 642	275 521	0,05
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.375% 19 - 05.03.24	100 000	EUR	98 578	99 466	0,02
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.75% 18 - 22.03.23	462 000	EUR	469 890	470 889	0,08
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 0.25% 18 - 27.09.21	400 000	EUR	399 854	401 616	0,07
Great-West Lifeco Inc. 1.75% 16 - 12.07.26	200 000	EUR	211 051	210 578	0,04
Great-West Lifeco Inc. 2.50% 13 - 18.04.23	100 000	EUR	105 481	105 526	0,02
Magna International Inc. 1.50% 17 - 25.09.27	100 000	EUR	95 439	101 830	0,02
Magna International Inc. 1.50% 17 - 25.09.27	100 000	EUR	100 892	101 830	0,02
Magna International Inc. 1.90% 15 - 24.11.23	200 000	EUR	208 943	207 530	0,03
Royal Bank of Canada 0.125% 19 - 23.07.24	300 000	EUR	300 328	297 861	0,05
Royal Bank of Canada 0.25% 19 - 05.02.24	200 000	EUR	200 292	199 944	0,03
Toronto-Dominion Bank 0.375% 19 - 25.04.24	600 000	EUR	602 505	601 974	0,10
Toronto-Dominion Bank 0.625% 18 - 20.07.23	550 000	EUR	560 787	560 796	0,09
Total Capital Canada Ltd. 1.125% 14 - 18.03.22	300 000	EUR	305 501	305 376	0,05
Total Capital Canada Ltd. 2.125% 14 - 18.09.29	600 000	EUR	680 590	685 602	0,12
			5 578 025	5 594 197	0,95
Îles Caïmans					
XLIT Ltd. FRN 17 - 29.06.47	200 000	EUR	213 509	212 144	0,04
			213 509	212 144	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Chine					
Bank of Communications Co. Ltd. FRN 14 - 10.03.26	150 000	EUR	151 450	151 562	0,02
China Merchants Bank Co. Ltd 0.25% 19 - 19.06.22	100 000	EUR	100 266	97 201	0,02
			251 716	248 763	0,04
Danemark					
AP Moller - Maersk A/S 1.50% 15 - 24.11.22	300 000	EUR	302 274	305 448	0,05
AP Moller - Maersk A/S 1.75% 18 - 16.03.26	200 000	EUR	206 633	201 332	0,03
DSV PANALPINA A/S 0.375% 20 - 26.02.27	200 000	EUR	186 941	189 966	0,03
ISS Global A/S 0.875% 19 - 18.06.26	200 000	EUR	201 063	193 922	0,03
ISS Global A/S 1.50% 17 - 31.08.27	200 000	EUR	200 854	198 266	0,03
ISS Global A/S 2.125% 14 - 12.02.24	200 000	EUR	209 547	207 864	0,04
Jyske Bank A/S FRN 19 - 20.06.24	300 000	EUR	298 609	296 460	0,05
Jyske Bank A/S 0.875% 18 - 12.03.21	283 000	EUR	286 499	284 559	0,05
Nykredit Realkredit A/S 0.125% 19 - 07.10.24	100 000	EUR	99 309	96 283	0,02
Nykredit Realkredit A/S 0.25% 19 - 20.01.23	330 000	EUR	324 741	325 370	0,06
Nykredit Realkredit A/S 0.50% 18 - 19.01.22	300 000	EUR	299 973	299 625	0,05
Nykredit Realkredit A/S 0.625% 19 - 17.01.25	300 000	EUR	298 355	293 295	0,05
Nykredit Realkredit A/S 0.75% 16 - 14.07.21	100 000	EUR	100 438	100 271	0,02
Nykredit Realkredit A/S 0.75% 20 - 20.01.27	310 000	EUR	308 828	300 722	0,05
Nykredit Realkredit A/S 0.875% 19 - 17.01.24	200 000	EUR	201 518	199 690	0,03
Nykredit Realkredit A/S FRN 15 - 17.11.27	200 000	EUR	202 226	205 908	0,04
Sydbank A/S 1.25% 19 - 02.04.22	200 000	EUR	200 659	199 554	0,03
Sydbank A/S 1.375% 18 - 18.09.23	100 000	EUR	103 324	99 977	0,02
			4 031 791	3 998 512	0,68
Estonie					
Luminor Bank AS Via Estonia 1.375% 19 - 21.10.22	100 000	EUR	100 877	98 468	0,02
Luminor Bank AS Via Estonia 1.50% 18 - 18.10.21	153 000	EUR	154 863	151 852	0,02
			255 740	250 320	0,04
Finlande					
CRH Finland Services OYJ 0.875% 20 - 11.05.23	200 000	EUR	200 349	203 106	0,03
Elisa OYJ 0.875% 17 - 17.03.24	100 000	EUR	102 441	101 783	0,02
Elisa OYJ 1.125% 19 - 26.02.26	100 000	EUR	100 012	102 968	0,02
Kojamo OYJ 1.50% 17 - 19.06.24	135 000	EUR	136 851	138 636	0,02
Kojamo OYJ 1.625% 18 - 03.07.25	135 000	EUR	136 200	139 034	0,02
Kojamo OYJ 1.875% 20 - 27.05.27	200 000	EUR	202 823	207 326	0,03
Metso OYJ 1.125% 17 - 13.06.24	100 000	EUR	103 011	98 703	0,02
Nordea Bank Abp 0.30% 17 - 30.06.22	300 000	EUR	301 093	302 190	0,05
Nordea Bank Abp 0.375% 19 - 28.05.26	250 000	EUR	251 577	254 842	0,04
Nordea Bank Abp 0.50% 20 - 14.05.27	500 000	EUR	506 333	511 035	0,09
Nordea Bank Abp 0.875% 18 - 26.06.23	150 000	EUR	151 584	152 181	0,03
Nordea Bank Abp 1.00% 16 - 22.02.23	550 000	EUR	564 107	565 191	0,10
Nordea Bank Abp FRN 16 - 09.07.26	400 000	EUR	398 925	398 664	0,07
Nordea Bank Abp FRN 19 - 27.06.29	200 000	EUR	198 022	194 076	0,03
Nordea Bank Abp 1.125% 15 - 02.12.25	450 000	EUR	466 412	473 841	0,08
Nordea Bank Abp 1.125% 17 - 27.09.27	300 000	EUR	314 806	320 610	0,05
Nordea Bank Abp 3.25% 12 - 07.05.22	400 000	EUR	425 921	426 452	0,07
OP Corporate Bank PLC 0.125% 20 - 07.01.24	100 000	EUR	99 960	99 756	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.375% 17 - 10.11.22	100 000	EUR	100 672	100 768	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.375% 18 - 29.08.23	200 000	EUR	202 592	202 098	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Finlande (suite)					
OP Corporate Bank PLC 0.375% 19 - 26.02.24	100 000	EUR	100 943	101 310	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.375% 19 - 19.06.24	200 000	EUR	200 504	198 198	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.50% 20 - 08.12.25	450 000	EUR	453 410	455 895	0,08
OP Corporate Bank PLC 0.60% 20 - 18.01.27	137 000	EUR	138 648	136 312	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.625% 19 - 11.12.29	200 000	EUR	192 192	196 248	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.75% 15 - 03.03.22	350 000	EUR	354 917	354 200	0,06
OP Corporate Bank PLC 0.875% 16 - 21.06.21	200 000	EUR	201 558	201 906	0,03
OP Corporate Bank PLC 1.00% 18 - 22.05.25	150 000	EUR	154 314	156 741	0,03
OP Corporate Bank PLC 5.75% 12 - 28.02.22	200 000	EUR	216 985	215 634	0,04
SATO OYJ 1.375% 19 - 31.05.24	100 000	EUR	100 384	97 641	0,02
SATO OYJ 2.25% 20 - 04.07.23	100 000	EUR	100 454	101 558	0,02
			7 178 000	7 208 903	1,22
France					
Air Liquide Finance SA 0.375% 16 - 18.04.22	300 000	EUR	301 702	301 455	0,05
Air Liquide Finance SA 0.50% 16 - 13.06.22	100 000	EUR	100 967	100 837	0,02
Air Liquide Finance SA 0.625% 19 - 20.06.30	200 000	EUR	202 671	206 132	0,03
Air Liquide Finance SA 0.75% 16 - 13.06.24	100 000	EUR	100 398	102 754	0,02
Air Liquide Finance SA 1.00% 17 - 03.08.27	200 000	EUR	210 627	211 910	0,04
Air Liquide Finance SA 1.00% 20 - 04.02.25	200 000	EUR	205 539	208 296	0,04
Air Liquide Finance SA 1.25% 15 - 06.03.25	200 000	EUR	212 563	210 790	0,04
Air Liquide Finance SA 1.25% 16 - 13.06.28	400 000	EUR	426 017	434 648	0,07
Air Liquide Finance SA 1.375% 20 - 04.02.30	200 000	EUR	212 476	218 672	0,04
Air Liquide Finance SA 1.875% 14 - 06.05.24	200 000	EUR	215 000	214 690	0,04
Air Liquide SA 2.375% 13 - 09.06.23	100 000	EUR	106 877	107 534	0,02
ALD SA 0.375% 19 - 18.07.23	100 000	EUR	95 226	96 968	0,02
ALD SA 0.875% 17 - 18.07.22	200 000	EUR	201 137	196 484	0,03
ALD SA 1.25% 18 - 10.11.22	200 000	EUR	200 003	198 228	0,03
Alstom SA 0.25% 19 - 14.10.26	200 000	EUR	199 274	191 178	0,03
APRR SA Zero Coupon 20 - 20.01.23	300 000	EUR	296 646	298 245	0,05
APRR SA 1.125% 16 - 01.09.26	200 000	EUR	201 597	208 386	0,04
APRR SA 1.25% 16 - 01.06.27	200 000	EUR	202 455	211 220	0,04
APRR SA 1.25% 19 - 18.01.28	200 000	EUR	203 083	211 300	0,04
APRR SA 1.25% 20 - 14.01.27	200 000	EUR	205 860	209 760	0,04
APRR SA 1.50% 15 - 15.01.24	100 000	EUR	102 348	103 859	0,02
APRR SA 1.50% 15 - 15.01.24	100 000	EUR	103 591	103 859	0,02
APRR SA 1.50% 17 - 17.01.33	200 000	EUR	200 545	218 188	0,04
APRR SA 1.50% 18 - 25.01.30	200 000	EUR	209 897	216 548	0,04
APRR SA 1.625% 17 - 13.01.32	200 000	EUR	211 175	218 766	0,04
APRR SA 1.875% 14 - 15.01.25	200 000	EUR	207 831	213 458	0,04
APRR SA 1.875% 16 - 01.06.31	200 000	EUR	210 256	222 066	0,04
Arkema SA 0.75% 19 - 12.03.29	200 000	EUR	195 242	193 860	0,03
Arkema SA 1.50% 15 - 20.01.25	200 000	EUR	208 633	209 026	0,04
Arkema SA 1.50% 17 - 20.04.27	300 000	EUR	315 532	313 575	0,05
Arkema SA FRN 20 - 31.12.99	100 000	EUR	100 000	94 135	0,02
Arkema SA FRN 19 - 31.12.99	200 000	EUR	205 131	200 042	0,03
Atos SE 0.75% 18 - 05.07.22	300 000	EUR	302 038	302 739	0,05
Atos SE 1.75% 18 - 05.07.25	300 000	EUR	312 572	317 706	0,05
Atos SE 2.50% 18 - 11.07.28	100 000	EUR	112 226	114 517	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Auchan Holding SA 0.625% 17 - 02.07.22	200 000	EUR	200 172	196 914	0,03
Auchan Holding SA 2.25% 13 - 04.06.23	400 000	EUR	409 381	404 744	0,07
Auchan Holding SA 2.375% 12 - 12.12.22	200 000	EUR	205 553	203 990	0,03
Auchan Holding SA 2.375% 19 - 25.04.25	400 000	EUR	404 863	396 960	0,07
Auchan Holding SA 2.625% 19 - 30.01.24	300 000	EUR	307 997	305 856	0,05
Auchan Holding SA 2.875% 20 - 29.01.26	400 000	EUR	404 759	399 740	0,07
Autoroutes du Sud de la France SA 1.00% 16 - 13.05.26	200 000	EUR	206 402	209 404	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 1.125% 17 - 20.04.26	100 000	EUR	105 736	105 276	0,02
Autoroutes du Sud de la France SA 1.25% 17 - 18.01.27	200 000	EUR	212 403	212 814	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 1.25% 17 - 18.01.27	200 000	EUR	209 553	212 814	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 22.01.30	400 000	EUR	427 739	434 752	0,07
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 27.06.28	300 000	EUR	313 096	324 267	0,05
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 19 - 21.02.31	400 000	EUR	425 095	435 356	0,07
Autoroutes du Sud de la France SA 2.875% 13 - 18.01.23	300 000	EUR	322 147	320 685	0,05
Autoroutes du Sud de la France SA 2.95% 14 - 17.01.24	200 000	EUR	220 169	218 234	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 5.625% 07 - 07.04.22	450 000	EUR	502 164	498 271	0,08
AXA SA 1.125% 16 - 15.05.28	200 000	EUR	209 046	216 214	0,04
AXA SA FRN 18 - 28.05.49	750 000	EUR	816 119	821 610	0,14
AXA SA FRN 16 - 07.06.47	532 000	EUR	586 096	582 801	0,10
AXA SA FRN 14 - 20.05.49	300 000	EUR	327 839	326 910	0,06
AXA SA FRN 14 - 29.11.49	100 000	EUR	104 083	108 135	0,02
AXA SA FRN 14 - 29.11.49	300 000	EUR	324 419	324 405	0,05
AXA SA FRN 13 - 07.04.43	400 000	EUR	453 099	445 524	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 18 - 30.08.21	300 000	EUR	300 665	300 285	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 19 - 02.05.24	600 000	EUR	599 213	598 482	0,10
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.375% 17 - 13.01.22	500 000	EUR	503 023	501 960	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.50% 18 - 16.11.22	600 000	EUR	606 995	605 424	0,10
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 18 - 17.07.25	200 000	EUR	202 008	205 468	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 20 - 17.01.30	400 000	EUR	397 017	396 092	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 15 - 14.01.25	500 000	EUR	518 840	523 795	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 17 - 26.05.27	400 000	EUR	417 091	427 704	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 20 - 06.03.30	400 000	EUR	404 590	411 708	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.375% 18 - 16.07.28	400 000	EUR	425 636	433 980	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 16 - 19.01.26	400 000	EUR	426 860	430 976	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 17 - 15.11.27	200 000	EUR	197 704	202 316	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.375% 16 - 24.03.26	300 000	EUR	314 967	315 546	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.50% 18 - 25.05.28	200 000	EUR	209 727	215 260	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 14 - 18.03.24	400 000	EUR	433 271	436 464	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 17 - 31.03.27	200 000	EUR	215 485	214 654	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 13 - 28.11.23	500 000	EUR	546 959	548 970	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 14 - 21.05.24	300 000	EUR	322 141	321 228	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 15 - 09.11.25	400 000	EUR	435 172	436 284	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.25% 12 - 23.08.22	500 000	EUR	533 243	533 735	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 18 - 17.07.25	400 000	EUR	408 202	410 936	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 19 - 15.06.23	500 000	EUR	507 726	509 425	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 19 - 06.08.26	600 000	EUR	607 607	614 406	0,10
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19 - 15.03.29	400 000	EUR	428 960	434 752	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 16 - 11.04.26	300 000	EUR	308 606	307 791	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 19 - 18.06.29	300 000	EUR	308 939	308 856	0,05
BNP Paribas Cardif SA 1.00% 17 - 29.11.24	200 000	EUR	198 311	198 286	0,03
BNP Paribas Cardif SA FRN 14 - 29.11.49	400 000	EUR	431 941	429 404	0,07
BNP Paribas SA 0.125% 19 - 09.04.26	400 000	EUR	387 587	384 056	0,07
BNP Paribas SA 0.50% 16 - 06.01.22	200 000	EUR	201 884	202 002	0,03
BNP Paribas SA FRN 19 - 15.07.25	300 000	EUR	302 933	297 111	0,05
BNP Paribas SA FRN 19 - 06.04.26	300 000	EUR	293 756	296 145	0,05
BNP Paribas SA FRN 20 - 19.02.28	400 000	EUR	391 468	389 108	0,07
BNP Paribas SA 0.75% 16 - 11.11.22	450 000	EUR	457 602	457 285	0,08
BNP Paribas SA 1.00% 17 - 27.06.24	300 000	EUR	304 707	304 935	0,05
BNP Paribas SA 1.00% 18 - 17.04.24	220 000	EUR	222 065	223 599	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
BNP Paribas SA 1.125% 16 - 15.01.23	500 000	EUR	511 268	513 670	0,09
BNP Paribas SA 1.125% 17 - 10.10.23	400 000	EUR	404 755	407 676	0,07
BNP Paribas SA 1.125% 18 - 06.11.26	500 000	EUR	502 614	509 175	0,09
BNP Paribas SA 1.125% 18 - 22.11.23	400 000	EUR	406 291	408 112	0,07
BNP Paribas SA 1.125% 19 - 28.08.24	200 000	EUR	205 932	204 296	0,03
BNP Paribas SA FRN 20 - 15.01.32	400 000	EUR	396 730	385 568	0,07
BNP Paribas SA FRN 20 - 17.04.29	400 000	EUR	395 467	403 808	0,07
BNP Paribas SA 1.25% 18 - 19.03.25	300 000	EUR	306 220	308 358	0,05
BNP Paribas SA 1.375% 19 - 28.05.29	600 000	EUR	617 902	625 908	0,11
BNP Paribas SA 1.50% 16 - 25.05.28	305 000	EUR	322 443	339 154	0,06
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 17.11.25	400 000	EUR	415 807	417 476	0,07
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 23.05.28	300 000	EUR	311 385	315 483	0,05
BNP Paribas SA 1.625% 16 - 23.02.26	400 000	EUR	428 623	438 196	0,07
BNP Paribas SA 1.625% 19 - 07.02.31	400 000	EUR	404 593	396 164	0,07
BNP Paribas SA FRN 19 - 23.01.27	700 000	EUR	741 989	748 391	0,13
BNP Paribas SA 2.25% 16 - 01.11.27	350 000	EUR	372 242	371 889	0,06
BNP Paribas SA 2.375% 14 - 20.05.24	300 000	EUR	322 204	327 531	0,06
BNP Paribas SA 2.375% 15 - 17.02.25	600 000	EUR	632 259	634 206	0,11
BNP Paribas SA FRN 18 - 20.11.30	200 000	EUR	208 138	211 738	0,04
BNP Paribas SA FRN 14 - 14.10.27	243 000	EUR	256 415	248 011	0,04
BNP Paribas SA 2.75% 15 - 27.01.26	300 000	EUR	325 150	324 432	0,05
BNP Paribas SA 2.875% 12 - 24.10.22	374 000	EUR	398 270	398 261	0,07
BNP Paribas SA 2.875% 13 - 26.09.23	600 000	EUR	652 984	655 416	0,11
BNP Paribas SA 2.875% 16 - 10.01.26	300 000	EUR	332 244	329 505	0,06
BNP Paribas SA 4.125% 11 - 14.01.22	400 000	EUR	427 666	424 864	0,07
BNP Paribas SA 4.125% 11 - 14.01.22	200 000	EUR	212 424	212 432	0,04
BNP Paribas SA 4.50% 11 - 21.03.23	457 000	EUR	514 186	512 466	0,09
BPCE SA 0.125% 19 - 12.04.24	200 000	EUR	197 472	199 218	0,03
BPCE SA 0.25% 20 - 15.01.26	400 000	EUR	398 267	397 336	0,07
BPCE SA 0.375% 16 - 10.05.23	200 000	EUR	200 585	201 502	0,03
BPCE SA 0.50% 19 - 24.02.27	300 000	EUR	297 939	294 618	0,05
BPCE SA 0.625% 18 - 26.09.23	500 000	EUR	502 849	507 525	0,09
BPCE SA 0.625% 19 - 26.09.24	100 000	EUR	100 358	99 973	0,02
BPCE SA 0.625% 19 - 26.09.24	500 000	EUR	497 060	499 865	0,08
BPCE SA 0.625% 20 - 15.01.30	300 000	EUR	302 176	303 993	0,05
BPCE SA 0.625% 20 - 28.04.25	500 000	EUR	504 198	507 450	0,09
BPCE SA 0.875% 18 - 31.01.24	400 000	EUR	401 363	403 780	0,07
BPCE SA 1.00% 16 - 10.05.28	400 000	EUR	411 614	423 164	0,07
BPCE SA 1.00% 19 - 15.07.24	400 000	EUR	411 207	412 620	0,07
BPCE SA 1.00% 19 - 04.01.25	400 000	EUR	403 184	405 344	0,07
BPCE SA 1.125% 15 - 14.12.22	100 000	EUR	102 640	102 203	0,02
BPCE SA 1.125% 17 - 18.01.23	400 000	EUR	404 178	405 308	0,07
BPCE SA 1.375% 18 - 23.03.26	300 000	EUR	311 040	310 242	0,05
BPCE SA 1.625% 18 - 31.01.28	300 000	EUR	317 892	317 775	0,05
BPCE SA FRN 14 - 07.08.26	400 000	EUR	410 194	406 752	0,07
BPCE SA FRN 15 - 30.11.27	300 000	EUR	312 670	311 781	0,05
BPCE SA 2.875% 13 - 16.01.24	300 000	EUR	328 071	327 510	0,06
BPCE SA 2.875% 16 - 22.04.26	300 000	EUR	320 847	329 592	0,06

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
BPCE SA 3.00% 14 - 19.07.24	200 000	EUR	222 213	222 432	0,04
BPCE SA 4.25% 12 - 02.06.23	200 000	EUR	222 038	220 898	0,04
BPCE SA 4.50% 12 - 02.10.22	500 000	EUR	537 577	535 665	0,09
BPCE SA 4.625% 13 - 18.07.23	300 000	EUR	337 337	333 045	0,06
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 2.125% 19 - 16.09.29	200 000	EUR	203 231	191 028	0,03
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 3.375% 18 - 24.09.28	200 000	EUR	207 425	210 608	0,04
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 6.00% 17 - 23.01.27	400 000	EUR	483 875	480 496	0,08
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama FRN 14 - 29.05.49	300 000	EUR	348 886	330 465	0,06
Capgemini SE 0.50% 16 - 11.09.21	200 000	EUR	200 984	200 448	0,03
Capgemini SE 0.625% 20 - 23.06.25	100 000	EUR	99 888	100 042	0,02
Capgemini SE 1.00% 18 - 18.10.24	200 000	EUR	201 970	203 882	0,03
Capgemini SE 1.125% 20 - 23.06.30	100 000	EUR	99 522	99 243	0,02
Capgemini SE 1.25% 20 - 15.04.22	200 000	EUR	202 346	202 568	0,03
Capgemini SE 1.625% 20 - 15.04.26	200 000	EUR	206 713	209 912	0,04
Capgemini SE 1.625% 20 - 15.04.26	100 000	EUR	104 707	104 956	0,02
Capgemini SE 1.75% 18 - 18.04.28	200 000	EUR	211 276	212 782	0,04
Capgemini SE 2.00% 20 - 15.04.29	300 000	EUR	316 136	322 518	0,05
Capgemini SE 2.375% 20 - 15.04.32	400 000	EUR	429 432	439 664	0,07
Capgemini SE 2.50% 15 - 07.01.23	400 000	EUR	421 416	423 512	0,07
Carmila SA 2.125% 18 - 03.07.28	200 000	EUR	193 245	194 358	0,03
Carmila SA 2.375% 15 - 18.09.23	200 000	EUR	204 751	204 924	0,03
Carmila SA 2.375% 16 - 16.09.24	200 000	EUR	198 163	201 490	0,03
Ceetrus SA 2.75% 19 - 26.11.26	100 000	EUR	102 656	97 215	0,02
Cie de Saint-Gobain 0.625% 19 - 15.03.24	200 000	EUR	201 018	201 998	0,03
Cie de Saint-Gobain 0.875% 18 - 21.09.23	200 000	EUR	203 371	203 464	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.00% 17 - 17.03.25	200 000	EUR	205 522	205 432	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.125% 18 - 23.03.26	300 000	EUR	309 069	310 692	0,05
Cie de Saint-Gobain 1.375% 17 - 14.06.27	200 000	EUR	208 828	209 306	0,04
Cie de Saint-Gobain 1.75% 20 - 04.03.23	300 000	EUR	303 666	311 085	0,05
Cie de Saint-Gobain 1.875% 18 - 21.09.28	300 000	EUR	317 438	323 295	0,05
Cie de Saint-Gobain 1.875% 19 - 15.03.31	400 000	EUR	417 474	431 344	0,07
Cie de Saint-Gobain 2.375% 20 - 10.04.27	300 000	EUR	304 557	331 374	0,06
Cie de Saint-Gobain 3.625% 12 - 28.03.22	300 000	EUR	319 837	318 039	0,05
Cie de Saint-Gobain 3.625% 12 - 15.06.21	300 000	EUR	309 008	310 197	0,05
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 0.375% 16 - 02.07.25	200 000	EUR	203 278	201 908	0,03
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 0.75% 16 - 09.09.28	200 000	EUR	199 352	206 300	0,03
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.00% 20 - 19.05.31	400 000	EUR	408 681	417 028	0,07
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.125% 17 - 13.10.27	200 000	EUR	209 821	211 506	0,04
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.875% 18 - 09.03.25	200 000	EUR	206 716	206 570	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 18 - 09.03.30	100 000	EUR	110 467	113 001	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 18 - 09.03.30	200 000	EUR	223 729	226 002	0,04
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 2.50% 18 - 09.03.38	300 000	EUR	355 500	382 926	0,06
CNP Assurances 1.875% 16 - 20.10.22	400 000	EUR	409 940	408 184	0,07
CNP Assurances FRN 19 - 27.07.50	300 000	EUR	301 370	289 713	0,05
CNP Assurances FRN 20 - 30.06.51	100 000	EUR	99 592	99 503	0,02
CNP Assurances 2.75% 19 - 02.05.29	200 000	EUR	216 555	219 166	0,04
CNP Assurances FRN 14 - 29.11.49	100 000	EUR	108 889	106 723	0,02
CNP Assurances FRN 14 - 06.05.45	200 000	EUR	221 593	222 524	0,04
CNP Assurances FRN 15 - 06.10.47	300 000	EUR	356 201	344 640	0,06
CNP Assurances FRN 11 - 30.09.41	100 000	EUR	115 289	106 772	0,02
CNP Assurances FRN 11 - 30.09.41	200 000	EUR	223 128	213 544	0,04
Coface SA 4.125% 14 - 27.03.24	200 000	EUR	217 609	216 538	0,04
Covivio 1.125% 19 - 17.09.31	200 000	EUR	194 092	188 522	0,03
Covivio 1.50% 17 - 21.06.27	300 000	EUR	306 089	302 232	0,05
Covivio 1.625% 17 - 17.10.24	100 000	EUR	101 092	101 725	0,02
Covivio 1.875% 16 - 20.05.26	100 000	EUR	102 741	102 988	0,02
Covivio 2.375% 18 - 20.02.28	100 000	EUR	112 263	106 154	0,02
Credit Agricole Assurances SA FRN 18 - 29.01.48	300 000	EUR	299 071	303 090	0,05
Credit Agricole Assurances SA FRN 15 - 31.12.49	100 000	EUR	105 239	107 376	0,02
Credit Agricole Assurances SA FRN 15 - 31.12.49	300 000	EUR	318 865	322 128	0,05
Credit Agricole Assurances SA FRN 14 - 31.10.49	200 000	EUR	215 850	219 072	0,04
Credit Agricole Assurances SA FRN 16 - 27.09.48	400 000	EUR	457 366	468 544	0,08
Credit Agricole SA 0.375% 19 - 21.10.25	100 000	EUR	99 886	98 575	0,02
Credit Agricole SA 0.375% 19 - 21.10.25	300 000	EUR	295 326	295 725	0,05
Credit Agricole SA 0.50% 19 - 24.06.24	400 000	EUR	400 348	399 140	0,07
Credit Agricole SA 0.75% 16 - 12.01.22	400 000	EUR	407 376	407 908	0,07
Credit Agricole SA 0.75% 18 - 12.05.23	400 000	EUR	405 304	409 432	0,07
Credit Agricole SA 0.875% 15 - 19.01.22	500 000	EUR	505 595	507 365	0,09
Credit Agricole SA 0.875% 20 - 14.01.32	500 000	EUR	494 678	492 420	0,08
Credit Agricole SA 1.00% 17 - 16.09.24	300 000	EUR	312 242	312 255	0,05
Credit Agricole SA 1.00% 19 - 07.03.29	400 000	EUR	413 444	426 600	0,07
Credit Agricole SA FRN 20 - 22.04.26	600 000	EUR	601 678	605 562	0,10
Credit Agricole SA 1.25% 16 - 14.04.26	500 000	EUR	525 501	532 430	0,09
Credit Agricole SA 1.375% 17 - 05.03.27	600 000	EUR	630 042	648 252	0,11
Credit Agricole SA 1.375% 18 - 13.03.25	400 000	EUR	413 030	414 580	0,07
Credit Agricole SA FRN 20 - 06.05.30	300 000	EUR	301 275	301 452	0,05
Credit Agricole SA 1.75% 19 - 03.05.29	600 000	EUR	637 819	645 108	0,11
Credit Agricole SA 1.875% 16 - 20.12.26	600 000	EUR	638 555	644 280	0,11
Credit Agricole SA 2.00% 19 - 25.03.29	400 000	EUR	406 992	414 692	0,07
Credit Agricole SA 2.375% 14 - 20.05.24	600 000	EUR	648 386	653 862	0,11
Credit Agricole SA 2.625% 15 - 17.03.27	650 000	EUR	699 331	700 589	0,12
Credit Agricole SA 3.125% 13 - 17.07.23	400 000	EUR	435 723	438 576	0,07
Credit Agricole SA 3.125% 14 - 02.05.26	300 000	EUR	343 782	350 433	0,06
Credit Agricole SA 5.125% 11 - 18.04.23	300 000	EUR	344 692	343 968	0,06

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Credit Mutuel Arkea SA 0.375% 19 - 10.03.28	200 000	EUR	197 550	196 362	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 18 - 10.05.23	100 000	EUR	102 940	101 763	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 20 - 05.07.27	200 000	EUR	201 791	203 630	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 1.00% 15 - 26.01.23	100 000	EUR	101 030	101 950	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 1.125% 19 - 23.05.29	200 000	EUR	203 169	206 732	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 1.25% 17 - 31.05.24	200 000	EUR	206 139	204 034	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 1.375% 19 - 17.01.25	200 000	EUR	203 725	209 064	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 1.625% 19 - 15.04.26	200 000	EUR	207 144	208 414	0,04
Credit Mutuel Arkea SA FRN 17 - 25.10.29	100 000	EUR	98 377	100 001	0,02
Credit Mutuel Arkea SA FRN 17 - 25.10.29	200 000	EUR	198 932	200 002	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 3.25% 16 - 06.01.26	200 000	EUR	221 002	221 956	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 19 - 03.11.31	300 000	EUR	330 250	334 725	0,06
Credit Mutuel Arkea SA 3.50% 17 - 02.09.29	100 000	EUR	112 484	113 328	0,02
Danone SA 0.395% 20 - 06.10.29	200 000	EUR	200 000	201 990	0,03
Danone SA 0.424% 16 - 11.03.22	400 000	EUR	402 016	403 196	0,07
Danone SA 0.571% 20 - 17.03.27	200 000	EUR	197 785	205 124	0,03
Danone SA 0.709% 16 - 11.03.24	500 000	EUR	511 869	514 545	0,09
Danone SA 1.00% 18 - 26.03.25	100 000	EUR	103 519	104 564	0,02
Danone SA 1.125% 15 - 14.01.25	200 000	EUR	208 028	209 838	0,04
Danone SA 1.208% 16 - 11.03.28	600 000	EUR	632 515	650 742	0,11
Danone SA 1.25% 15 - 30.05.24	400 000	EUR	418 005	418 564	0,07
Danone SA FRN 17 - 31.12.99	400 000	EUR	397 745	397 160	0,07
Danone SA 2.25% 13 - 15.11.21	300 000	EUR	308 198	307 527	0,05
Danone SA 2.60% 13 - 28.06.23	200 000	EUR	215 570	215 534	0,04
Dassault Systemes SE Zero Coupon 19 - 16.09.22	300 000	EUR	301 210	299 388	0,05
Dassault Systemes SE Zero Coupon 19 - 16.09.24	300 000	EUR	299 999	298 359	0,05
Dassault Systemes SE 0.125% 19 - 16.09.26	300 000	EUR	296 032	297 087	0,05
Dassault Systemes SE 0.375% 19 - 16.09.29	400 000	EUR	398 873	397 428	0,07
Edenred 1.375% 15 - 03.10.25	100 000	EUR	105 083	102 325	0,02
Edenred 1.875% 17 - 30.03.27	200 000	EUR	211 920	212 416	0,04
Edenred 1.875% 18 - 03.06.26	200 000	EUR	207 306	211 244	0,04
EssilorLuxottica SA Zero Coupon 19 - 27.05.23	200 000	EUR	200 330	199 380	0,03
EssilorLuxottica SA 0.125% 19 - 27.05.25	500 000	EUR	496 838	497 230	0,08
EssilorLuxottica SA 0.25% 20 - 01.05.24	300 000	EUR	300 868	301 221	0,05
EssilorLuxottica SA 0.375% 19 - 27.11.27	600 000	EUR	602 437	598 074	0,10
EssilorLuxottica SA 0.375% 20 - 01.05.26	500 000	EUR	499 192	500 155	0,08
EssilorLuxottica SA 0.50% 20 - 06.05.28	500 000	EUR	498 156	498 575	0,08
EssilorLuxottica SA 0.75% 19 - 27.11.31	300 000	EUR	299 769	302 847	0,05
EssilorLuxottica SA 2.375% 14 - 04.09.24	100 000	EUR	108 172	107 995	0,02
EssilorLuxottica SA 2.625% 14 - 02.10.24	100 000	EUR	108 102	108 693	0,02
Eutelsat SA 1.125% 16 - 23.06.21	100 000	EUR	100 886	100 143	0,02
Eutelsat SA 2.00% 18 - 10.02.25	300 000	EUR	296 722	305 916	0,05
Eutelsat SA 2.25% 19 - 13.07.27	200 000	EUR	211 241	202 700	0,03
Eutelsat SA 3.125% 12 - 10.10.22	100 000	EUR	106 936	104 658	0,02
Gecina SA 1.00% 16 - 30.01.29	200 000	EUR	199 549	201 858	0,03
Gecina SA 1.375% 17 - 30.06.27	100 000	EUR	103 420	104 528	0,02
Gecina SA 1.375% 17 - 26.01.28	300 000	EUR	312 835	312 645	0,05
Gecina SA 1.50% 15 - 20.01.25	200 000	EUR	210 296	207 686	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Gecina SA 1.625% 18 - 14.03.30	200 000	EUR	202 042	211 540	0,04
Gecina SA 1.625% 19 - 29.05.34	200 000	EUR	206 055	206 518	0,03
Gecina SA 2.00% 15 - 17.06.24	100 000	EUR	103 899	105 402	0,02
Gecina SA 2.00% 17 - 30.06.32	200 000	EUR	219 824	215 680	0,04
Holding d'Infrastructures de Transport SAS 0.625% 17 - 27.03.23	300 000	EUR	298 763	291 087	0,05
Holding d'Infrastructures de Transport SAS 1.625% 17 - 27.11.27	300 000	EUR	303 922	290 676	0,05
Holding d'Infrastructures de Transport SAS 2.25% 14 - 24.03.25	300 000	EUR	302 286	304 296	0,05
Holding d'Infrastructures de Transport SAS 4.875% 06 - 27.10.21	100 000	EUR	105 953	105 216	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 2.50% 20 - 05.04.27	200 000	EUR	198 064	205 664	0,03
HSBC France SA 0.10% 19 - 09.03.27	500 000	EUR	486 792	484 465	0,08
HSBC France SA 0.20% 18 - 09.04.21	600 000	EUR	602 467	601 500	0,10
HSBC France SA 0.25% 19 - 17.05.24	400 000	EUR	403 217	400 824	0,07
HSBC France SA 0.60% 18 - 20.03.23	300 000	EUR	305 147	304 239	0,05
HSBC France SA 0.60% 18 - 20.03.23	100 000	EUR	101 417	101 413	0,02
HSBC France SA 1.375% 18 - 09.04.28	300 000	EUR	326 358	326 244	0,06
Icade 1.75% 16 - 06.10.26	200 000	EUR	210 296	203 016	0,03
ICADE 1.125% 16 - 17.11.25	200 000	EUR	202 854	197 378	0,03
ICADE 1.50% 17 - 13.09.27	200 000	EUR	197 963	199 364	0,03
ICADE 1.625% 18 - 28.02.28	300 000	EUR	305 807	300 423	0,05
ICADE 1.875% 15 - 14.09.22	100 000	EUR	103 144	102 641	0,02
Icade Sante SAS 0.875% 19 - 11.04.29	200 000	EUR	184 069	184 104	0,03
Imerys SA 0.875% 16 - 31.03.22	100 000	EUR	100 500	98 910	0,02
Imerys SA 1.50% 17 - 15.01.27	200 000	EUR	187 675	192 656	0,03
Imerys SA 1.875% 16 - 31.03.28	100 000	EUR	104 878	97 181	0,02
Imerys SA 2.00% 14 - 12.10.24	200 000	EUR	206 548	203 004	0,03
JCDecaux SA 1.00% 16 - 06.01.23	300 000	EUR	296 951	294 882	0,05
JCDecaux SA 2.00% 20 - 24.10.24	300 000	EUR	296 976	303 132	0,05
JCDecaux SA 2.625% 20 - 24.04.28	100 000	EUR	100 000	101 537	0,02
Kering SA 0.25% 20 - 13.05.23	300 000	EUR	300 589	301 647	0,05
Kering SA 0.75% 20 - 13.05.28	200 000	EUR	201 683	203 830	0,03
Kering SA 1.25% 16 - 05.10.26	100 000	EUR	106 201	105 248	0,02
Kering SA 1.375% 14 - 10.01.21	200 000	EUR	203 923	203 162	0,03
Kering SA 1.50% 17 - 04.05.27	100 000	EUR	104 626	107 164	0,02
Kering SA 2.75% 14 - 04.08.24	100 000	EUR	107 417	109 828	0,02
Klepierre SA 0.625% 19 - 07.01.30	300 000	EUR	292 247	279 930	0,05
Klepierre SA 1.00% 15 - 17.04.23	200 000	EUR	200 387	200 378	0,03
Klepierre SA 1.25% 16 - 29.09.31	200 000	EUR	186 828	193 772	0,03
Klepierre SA 1.375% 17 - 16.02.27	200 000	EUR	211 010	201 332	0,03
Klepierre SA 1.625% 17 - 13.12.32	100 000	EUR	107 167	99 707	0,02
Klepierre SA 1.75% 14 - 11.06.24	200 000	EUR	205 986	207 068	0,04
Klepierre SA 1.875% 16 - 19.02.26	200 000	EUR	204 371	208 542	0,04
Klepierre SA 2.00% 20 - 05.12.29	200 000	EUR	200 779	208 876	0,04
Legrand SA 0.50% 17 - 10.09.23	200 000	EUR	202 256	201 902	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Legrand SA 0.625% 19 - 24.06.28	100 000	EUR	100 244	100 879	0,02
Legrand SA 0.625% 19 - 24.06.28	100 000	EUR	100 839	100 879	0,02
Legrand SA 0.75% 17 - 07.06.24	100 000	EUR	102 605	102 246	0,02
Legrand SA 0.75% 20 - 20.05.30	200 000	EUR	200 740	202 870	0,03
Legrand SA 1.00% 18 - 03.06.26	200 000	EUR	204 693	206 754	0,04
Legrand SA 1.875% 15 - 16.12.27	100 000	EUR	107 123	109 335	0,02
Legrand SA 1.875% 17 - 07.06.32	200 000	EUR	230 171	226 516	0,04
Mercialys SA 1.787% 14 - 31.03.23	200 000	EUR	206 056	194 998	0,03
Mercialys SA 1.80% 18 - 27.02.26	200 000	EUR	183 740	176 258	0,03
mFinance France SA 2.00% 14 - 26.11.21	200 000	EUR	201 034	201 894	0,03
Peugeot SA 1.125% 19 - 18.09.29	300 000	EUR	284 710	272 235	0,05
Peugeot SA 2.00% 17 - 23.03.24	355 000	EUR	358 541	359 654	0,06
Peugeot SA 2.00% 18 - 20.03.25	200 000	EUR	206 988	200 132	0,03
Peugeot SA 2.375% 16 - 14.04.23	100 000	EUR	101 858	101 746	0,02
Peugeot SA 2.75% 20 - 15.05.26	400 000	EUR	404 685	406 636	0,07
PSA Tresorerie GIE 6.00% 03 - 19.09.33	170 000	EUR	229 484	221 328	0,04
Publicis Groupe SA 0.50% 16 - 11.03.23	100 000	EUR	99 277	99 441	0,02
Publicis Groupe SA 1.125% 14 - 16.12.21	300 000	EUR	303 713	302 517	0,05
Publicis Groupe SA 1.625% 14 - 16.12.24	200 000	EUR	210 924	206 794	0,04
RCI Banque SA 0.25% 18 - 07.12.21	200 000	EUR	200 216	197 018	0,03
RCI Banque SA 0.25% 19 - 03.08.23	300 000	EUR	294 560	289 209	0,05
RCI Banque SA 0.50% 16 - 15.09.23	350 000	EUR	338 456	338 611	0,06
RCI Banque SA 0.625% 16 - 11.10.21	200 000	EUR	200 791	196 654	0,03
RCI Banque SA 0.75% 17 - 01.12.22	400 000	EUR	397 841	393 624	0,07
RCI Banque SA 0.75% 17 - 26.09.22	225 000	EUR	226 082	219 427	0,04
RCI Banque SA 0.75% 19 - 04.10.23	291 000	EUR	287 383	282 733	0,05
RCI Banque SA 1.00% 16 - 17.05.23	200 000	EUR	195 355	196 858	0,03
RCI Banque SA 1.125% 20 - 15.01.27	406 000	EUR	394 818	381 648	0,06
RCI Banque SA 1.25% 15 - 06.08.22	200 000	EUR	203 440	197 822	0,03
RCI Banque SA 1.375% 17 - 03.08.24	164 000	EUR	166 954	162 494	0,03
RCI Banque SA 1.625% 17 - 04.11.25	150 000	EUR	155 119	149 181	0,03
RCI Banque SA 1.625% 18 - 26.05.26	340 000	EUR	336 631	331 820	0,06
RCI Banque SA 1.75% 19 - 04.10.26	200 000	EUR	202 741	197 858	0,03
RCI Banque SA 2.00% 19 - 07.11.24	228 000	EUR	237 148	229 601	0,04
SANEF SA 0.95% 16 - 19.10.28	100 000	EUR	93 651	92 785	0,02
SANEF SA 1.875% 15 - 16.03.26	200 000	EUR	205 121	205 788	0,03
Sanofi Zero Coupon 16 - 13.09.22	200 000	EUR	200 478	200 294	0,03
Sanofi Zero Coupon 19 - 21.03.22	400 000	EUR	401 574	400 680	0,07
Sanofi 0.50% 16 - 13.01.27	500 000	EUR	505 273	512 430	0,09
Sanofi 0.50% 18 - 21.03.23	700 000	EUR	708 817	710 381	0,12
Sanofi 0.625% 16 - 04.05.24	200 000	EUR	203 355	204 922	0,03
Sanofi 0.875% 15 - 22.09.21	100 000	EUR	101 233	100 885	0,02
Sanofi 0.875% 19 - 21.03.29	300 000	EUR	312 669	316 083	0,05
Sanofi 1.00% 18 - 21.03.26	600 000	EUR	628 423	632 184	0,11
Sanofi 1.00% 20 - 04.01.25	400 000	EUR	414 459	417 808	0,07
Sanofi 1.125% 14 - 03.10.22	400 000	EUR	407 491	407 140	0,07
Sanofi 1.125% 16 - 04.05.28	200 000	EUR	206 351	214 464	0,04
Sanofi 1.25% 19 - 21.03.34	200 000	EUR	215 344	221 856	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Sanofi 1.375% 18 - 21.03.30	700 000	EUR	747 141	772 632	0,13
Sanofi 1.50% 15 - 22.09.25	200 000	EUR	212 622	214 922	0,04
Sanofi 1.50% 20 - 04.01.30	400 000	EUR	435 453	444 400	0,08
Sanofi 1.75% 14 - 09.10.26	500 000	EUR	540 295	550 120	0,09
Sanofi 1.875% 18 - 21.03.38	400 000	EUR	448 802	476 392	0,08
Sanofi 2.50% 13 - 14.11.23	300 000	EUR	325 021	324 297	0,05
Schlumberger Finance France SAS 1.00% 18 - 18.02.26	300 000	EUR	308 507	304 083	0,05
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 18 - 29.05.25	200 000	EUR	203 139	206 786	0,04
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 20 - 06.05.27	200 000	EUR	201 782	205 512	0,03
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.875% 14 - 26.11.21	100 000	EUR	101 224	101 285	0,02
Societe Fonciere Lyonnaise SA 2.25% 15 - 16.11.22	100 000	EUR	103 282	103 311	0,02
Societe Generale SA Zero Coupon 19 - 27.05.22	600 000	EUR	599 316	598 158	0,10
Societe Generale SA 0.125% 16 - 10.05.21	200 000	EUR	200 649	200 102	0,03
Societe Generale SA 0.125% 20 - 24.02.26	400 000	EUR	394 222	395 012	0,07
Societe Generale SA 0.125% 20 - 24.02.26	100 000	EUR	99 057	98 753	0,02
Societe Generale SA 0.25% 18 - 18.01.22	700 000	EUR	701 516	701 785	0,12
Societe Generale SA 0.50% 17 - 13.01.23	300 000	EUR	296 466	297 963	0,05
Societe Generale SA 0.75% 16 - 26.05.23	400 000	EUR	407 285	406 436	0,07
Societe Generale SA 0.75% 20 - 25.01.27	600 000	EUR	588 589	585 192	0,10
Societe Generale SA 0.875% 19 - 07.01.26	200 000	EUR	201 911	197 854	0,03
Societe Generale SA 0.875% 19 - 24.09.29	300 000	EUR	293 947	290 760	0,05
Societe Generale SA 1.00% 16 - 04.01.22	300 000	EUR	304 427	302 526	0,05
Societe Generale SA 1.125% 18 - 23.01.25	400 000	EUR	400 713	403 252	0,07
Societe Generale SA FRN 20 - 21.04.26	300 000	EUR	298 895	300 033	0,05
Societe Generale SA 1.25% 19 - 15.02.24	600 000	EUR	606 112	607 644	0,10
Societe Generale SA 1.375% 17 - 13.01.28	300 000	EUR	304 604	304 728	0,05
Societe Generale SA FRN 18 - 23.02.28	300 000	EUR	301 325	298 617	0,05
Societe Generale SA 1.75% 19 - 22.03.29	500 000	EUR	516 538	522 400	0,09
Societe Generale SA 2.125% 18 - 27.09.28	400 000	EUR	430 154	429 032	0,07
Societe Generale SA FRN 14 - 16.09.26	400 000	EUR	410 962	402 424	0,07
Societe Generale SA 2.625% 15 - 27.02.25	400 000	EUR	428 748	426 220	0,07
Societe Generale SA 4.00% 13 - 06.07.23	100 000	EUR	109 859	108 805	0,02
Societe Generale SA 4.00% 13 - 06.07.23	300 000	EUR	327 355	326 415	0,06
Societe Generale SA 4.25% 12 - 13.07.22	300 000	EUR	326 930	324 267	0,05
Sodexo SA 0.75% 16 - 14.04.27	250 000	EUR	256 320	249 093	0,04
Sodexo SA 0.75% 20 - 27.04.25	200 000	EUR	200 154	200 448	0,03
Sodexo SA 1.00% 20 - 27.04.29	330 000	EUR	326 798	325 139	0,06
Sodexo SA 1.125% 18 - 22.05.25	100 000	EUR	100 474	102 591	0,02
Sodexo SA 1.75% 14 - 24.01.22	315 000	EUR	321 508	321 596	0,05
Sodexo SA 2.50% 14 - 24.06.26	100 000	EUR	108 215	110 726	0,02
Sogecap SA FRN 14 - 29.12.49	300 000	EUR	324 850	316 257	0,05
Suez SA 0.50% 19 - 14.10.31	200 000	EUR	199 977	194 992	0,03
Suez SA 1.00% 17 - 04.03.25	300 000	EUR	308 743	309 150	0,05
Suez SA 1.25% 16 - 19.05.28	300 000	EUR	315 917	315 429	0,05
Suez SA 1.25% 20 - 04.02.27	400 000	EUR	412 247	419 888	0,07
Suez SA 1.25% 20 - 14.05.35	300 000	EUR	300 773	304 866	0,05
Suez SA 1.50% 17 - 04.03.29	200 000	EUR	211 007	215 432	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Suez SA 1.625% 17 - 21.09.32	100 000	EUR	112 356	109 271	0,02
Suez SA 1.625% 18 - 17.09.30	200 000	EUR	211 628	218 832	0,04
Suez SA FRN 19 - 31.12.99	200 000	EUR	192 545	187 566	0,03
Suez SA 1.75% 15 - 09.10.25	200 000	EUR	211 170	213 792	0,04
Suez SA 2.75% 13 - 10.09.23	200 000	EUR	218 102	216 800	0,04
Suez SA FRN 17 - 31.12.99	300 000	EUR	312 733	302 244	0,05
Suez SA 4.125% 10 - 24.06.22	200 000	EUR	215 945	216 260	0,04
Suez SA 5.50% 09 - 22.07.24	100 000	EUR	121 278	121 274	0,02
Teleperformance 1.50% 17 - 04.03.24	200 000	EUR	200 216	202 788	0,03
Teleperformance 1.875% 18 - 07.02.25	300 000	EUR	314 995	310 884	0,05
Terega SA 2.20% 15 - 08.05.25	200 000	EUR	210 615	211 952	0,04
Terega SA 4.339% 11 - 07.07.21	200 000	EUR	207 707	207 624	0,04
Total Capital International SA 0.25% 16 - 07.12.23	500 000	EUR	500 947	502 590	0,09
Total Capital International SA 0.625% 17 - 10.04.24	200 000	EUR	204 370	203 942	0,03
Total Capital International SA 0.696% 19 - 31.05.28	300 000	EUR	308 767	304 611	0,05
Total Capital International SA 0.75% 16 - 07.12.28	500 000	EUR	502 819	509 735	0,09
Total Capital International SA 0.952% 20 - 18.05.31	200 000	EUR	203 261	205 302	0,03
Total Capital International SA 1.023% 18 - 03.04.27	200 000	EUR	209 859	208 402	0,04
Total Capital International SA 1.375% 14 - 19.03.25	300 000	EUR	314 985	316 578	0,05
Total Capital International SA 1.375% 17 - 10.04.29	400 000	EUR	425 433	430 280	0,07
Total Capital International SA 1.491% 18 - 09.04.30	300 000	EUR	329 833	325 743	0,06
Total Capital International SA 1.491% 20 - 04.08.27	500 000	EUR	525 881	533 015	0,09
Total Capital International SA 1.535% 19 - 31.05.39	200 000	EUR	211 069	210 590	0,04
Total Capital International SA 1.618% 20 - 18.05.40	400 000	EUR	421 286	417 316	0,07
Total Capital International SA 1.994% 20 - 04.08.32	400 000	EUR	445 252	450 952	0,08
Total Capital International SA 1.994% 20 - 04.08.32	100 000	EUR	109 752	112 738	0,02
Total Capital International SA 2.125% 12 - 15.03.23	300 000	EUR	317 588	316 341	0,05
Total Capital International SA 2.125% 13 - 19.11.21	200 000	EUR	206 467	205 550	0,03
Total Capital International SA 2.50% 14 - 25.03.26	100 000	EUR	114 137	112 453	0,02
Total Capital International SA 2.50% 14 - 25.03.26	200 000	EUR	221 481	224 906	0,04
Total Capital International SA 2.875% 13 - 19.11.25	300 000	EUR	343 254	341 205	0,06
Total Capital SA 3.125% 10 - 16.09.22	72 000	EUR	77 239	76 767	0,01
Total Capital SA 5.125% 09 - 26.03.24	394 000	EUR	465 653	466 598	0,08
TOTAL SA FRN 19 - 31.12.99	550 000	EUR	555 503	543 455	0,09
TOTAL SA FRN 15 - 29.12.49	950 000	EUR	983 047	971 375	0,16
TOTAL SA FRN 16 - 29.12.49	300 000	EUR	310 105	305 682	0,05
TOTAL SA FRN 16 - 29.12.49	600 000	EUR	654 825	638 502	0,11
TOTAL SA FRN 16 - 29.12.49	700 000	EUR	752 865	723 765	0,12
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 0.875% 16 - 21.02.25	200 000	EUR	203 682	197 330	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 0.875% 19 - 29.03.32	300 000	EUR	299 571	265 503	0,04
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.00% 19 - 27.02.27	300 000	EUR	305 081	290 901	0,05
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.125% 16 - 28.04.27	200 000	EUR	200 111	195 338	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.125% 18 - 15.09.25	300 000	EUR	305 690	297 063	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.375% 15 - 15.04.30	200 000	EUR	211 201	193 940	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.50% 17 - 22.02.28	200 000	EUR	207 967	198 826	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.50% 17 - 29.05.29	200 000	EUR	200 986	195 946	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.75% 19 - 27.02.34	300 000	EUR	304 824	289 101	0,05
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.75% 19 - 07.01.49	200 000	EUR	176 373	172 348	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 1.875% 18 - 15.01.31	300 000	EUR	307 595	300 381	0,05
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.00% 16 - 28.04.36	100 000	EUR	112 362	97 917	0,02
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.00% 17 - 29.05.37	200 000	EUR	200 356	193 652	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. FRN 18 - 31.12.99	300 000	EUR	304 869	261 750	0,04
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.125% 20 - 04.09.25	300 000	EUR	305 445	310 827	0,05
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.25% 18 - 14.05.38	200 000	EUR	203 763	199 512	0,03
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.50% 13 - 06.12.23	100 000	EUR	106 495	103 876	0,02
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.50% 14 - 26.02.24	300 000	EUR	317 892	314 841	0,05
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. 2.625% 20 - 04.09.30	300 000	EUR	313 623	321 549	0,05
Unibail-Rodamco SE Via Westfield Corp. FRN 18 - 31.12.99	300 000	EUR	292 139	264 069	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 15 - 14.03.25	152 000	EUR	158 997	150 523	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 14 - 17.10.22	200 000	EUR	198 864	201 532	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 16 - 03.09.26	250 000	EUR	258 852	250 435	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.50% 14 - 06.04.26	150 000	EUR	155 746	158 505	0,03
Valeo SA 0.375% 17 - 09.12.22	200 000	EUR	200 371	193 546	0,03
Valeo SA 0.625% 17 - 01.11.23	100 000	EUR	100 268	96 814	0,02
Valeo SA 1.50% 18 - 18.06.25	300 000	EUR	302 664	285 405	0,05
Valeo SA 1.625% 16 - 18.03.26	300 000	EUR	289 229	287 382	0,05
Valeo SA 3.25% 14 - 22.01.24	200 000	EUR	220 240	205 790	0,03
Veolia Environnement SA 0.314% 16 - 10.04.23	200 000	EUR	198 163	200 782	0,03
Veolia Environnement SA 0.664% 20 - 15.01.31	300 000	EUR	301 694	296 583	0,05
Veolia Environnement SA 0.672% 17 - 30.03.22	300 000	EUR	301 611	301 902	0,05
Veolia Environnement SA 0.892% 19 - 14.01.24	300 000	EUR	306 354	306 159	0,05
Veolia Environnement SA 0.927% 16 - 01.04.29	200 000	EUR	204 489	205 200	0,03
Veolia Environnement SA 1.25% 20 - 15.04.28	300 000	EUR	314 156	315 255	0,05
Veolia Environnement SA 1.496% 17 - 30.11.26	200 000	EUR	212 471	213 954	0,04
Veolia Environnement SA 1.59% 15 - 01.10.28	200 000	EUR	211 816	215 944	0,04
Veolia Environnement SA 1.94% 18 - 01.07.30	300 000	EUR	324 280	334 128	0,06

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Veolia Environnement SA 4.625% 12 - 30.03.27	300 000	EUR	377 154	383 259	0,06
Veolia Environnement SA 5.125% 07 - 24.05.22	159 000	EUR	174 565	173 283	0,03
Veolia Environnement SA 6.125% 03 - 25.11.33	150 000	EUR	237 315	245 258	0,04
Vinci SA 1.00% 18 - 26.09.25	300 000	EUR	310 116	313 002	0,05
Vinci SA 1.625% 19 - 18.01.29	300 000	EUR	326 186	328 680	0,06
Vinci SA 1.75% 18 - 26.09.30	400 000	EUR	428 071	449 632	0,08
Vivendi SA Zero Coupon 19 - 13.06.22	300 000	EUR	300 336	297 681	0,05
Vivendi SA 0.625% 19 - 06.11.25	200 000	EUR	201 978	199 566	0,03
Vivendi SA 0.875% 17 - 18.09.24	200 000	EUR	201 436	202 676	0,03
Vivendi SA 1.125% 16 - 24.11.23	200 000	EUR	205 720	204 278	0,03
Vivendi SA 1.125% 19 - 12.11.28	300 000	EUR	301 795	302 160	0,05
Vivendi SA 1.875% 16 - 26.05.26	200 000	EUR	210 890	212 776	0,04
Wendel SE 1.375% 19 - 26.04.26	100 000	EUR	104 148	99 940	0,02
Wendel SE 2.50% 15 - 02.09.27	200 000	EUR	223 114	210 172	0,04
Wendel SE 2.75% 14 - 10.02.24	200 000	EUR	215 545	213 836	0,04
Worldline SA 0.25% 19 - 18.09.24	100 000	EUR	99 885	98 352	0,02
Worldline SA 0.25% 19 - 18.09.24	100 000	EUR	98 458	98 352	0,02
WPP Finance SA 2.25% 14 - 22.09.26	336 000	EUR	352 909	346 335	0,06
WPP Finance SA 2.375% 20 - 19.05.27	200 000	EUR	200 395	205 514	0,03
			147 700 525	147 740 342	25,04
Allemagne					
Aareal Bank AG 0.375% 19 - 04.10.24	300 000	EUR	299 370	299 124	0,05
Allianz SE FRN 19 - 25.09.49	300 000	EUR	299 470	288 831	0,05
Allianz SE FRN 20 - 07.08.50	400 000	EUR	408 563	405 576	0,07
Allianz SE FRN 15 - 07.07.45	100 000	EUR	98 221	104 139	0,02
Allianz SE FRN 15 - 07.07.45	400 000	EUR	419 243	416 556	0,07
Allianz SE FRN 17 - 07.06.47	400 000	EUR	440 486	442 348	0,07
Allianz SE FRN 14 - 31.12.99	600 000	EUR	645 122	635 508	0,11
Allianz SE FRN 13 - 31.12.49	200 000	EUR	223 427	219 660	0,04
Allianz SE FRN 13 - 31.12.49	400 000	EUR	449 554	439 320	0,07
Allianz SE FRN 12 - 17.10.42	100 000	EUR	116 391	109 990	0,02
Allianz SE FRN 12 - 17.10.42	400 000	EUR	458 611	439 960	0,07
alstria office REIT-AG 0.50% 19 - 26.09.25	200 000	EUR	193 278	192 624	0,03
alstria office REIT-AG 1.50% 17 - 15.11.27	100 000	EUR	103 790	98 694	0,02
alstria office REIT-AG 2.125% 16 - 04.12.23	100 000	EUR	102 665	102 408	0,02
Amphenol Technologies Holding GmbH 0.75% 20 - 05.04.26	200 000	EUR	199 808	199 826	0,03
Amphenol Technologies Holding GmbH 2.00% 18 - 10.08.28	200 000	EUR	212 429	216 290	0,04
Berlin Hyp AG 0.375% 18 - 28.08.23	200 000	EUR	202 293	202 476	0,03
Berlin Hyp AG 0.50% 16 - 26.09.23	100 000	EUR	101 196	100 582	0,02
Berlin Hyp AG 0.50% 19 - 11.05.29	100 000	EUR	99 212	100 066	0,02
Berlin Hyp AG 1.00% 19 - 02.05.26	200 000	EUR	206 798	209 034	0,04
Berlin Hyp AG 1.125% 17 - 25.10.27	200 000	EUR	202 577	205 156	0,03
Berlin Hyp AG 1.25% 15 - 22.01.25	300 000	EUR	304 517	310 005	0,05
Berlin Hyp AG 1.50% 18 - 18.04.28	200 000	EUR	212 477	211 528	0,04
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.125% 16 - 27.04.26	100 000	EUR	100 443	104 037	0,02
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.25% 18 - 29.09.25	300 000	EUR	309 085	312 387	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.50% 20 - 15.05.30	300 000	EUR	302 548	309 135	0,05
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.75% 14 - 14.10.24	200 000	EUR	210 506	212 326	0,04
Bertelsmann SE & Co. KGaA 2.00% 20 - 04.01.28	300 000	EUR	309 079	324 327	0,05
Bertelsmann SE & Co. KGaA 2.625% 12 - 08.02.22	300 000	EUR	315 700	316 119	0,05
Commerzbank AG 0.25% 19 - 16.09.24	200 000	EUR	197 818	191 110	0,03
Commerzbank AG 0.50% 16 - 13.09.23	300 000	EUR	296 589	294 666	0,05
Commerzbank AG 0.50% 18 - 28.08.23	504 000	EUR	504 725	504 292	0,09
Commerzbank AG 0.50% 18 - 12.06.21	200 000	EUR	200 911	200 912	0,03
Commerzbank AG 0.50% 19 - 12.04.26	190 000	EUR	184 402	187 184	0,03
Commerzbank AG 0.625% 19 - 28.08.24	210 000	EUR	212 268	209 912	0,04
Commerzbank AG 0.875% 20 - 22.01.27	400 000	EUR	395 822	383 324	0,06
Commerzbank AG 1.00% 19 - 03.04.26	620 000	EUR	620 118	628 947	0,11
Commerzbank AG 1.125% 17 - 24.05.24	130 000	EUR	129 089	129 563	0,02
Commerzbank AG 1.125% 17 - 19.09.25	100 000	EUR	97 439	99 277	0,02
Commerzbank AG 1.125% 19 - 22.06.26	200 000	EUR	202 137	196 302	0,03
Commerzbank AG 1.25% 18 - 23.10.23	100 000	EUR	99 067	100 450	0,02
Commerzbank AG 1.50% 15 - 21.09.22	197 000	EUR	202 178	199 618	0,03
Commerzbank AG 1.50% 18 - 28.08.28	250 000	EUR	261 091	263 390	0,04
Commerzbank AG 1.875% 18 - 28.02.28	200 000	EUR	202 393	205 574	0,03
Continental AG Zero Coupon 19 - 09.12.23	100 000	EUR	99 680	97 738	0,02
Continental AG 0.375% 19 - 27.06.25	206 000	EUR	206 050	196 738	0,03
Continental AG 2.50% 20 - 27.08.26	340 000	EUR	354 749	358 584	0,06
Covestro AG 0.875% 20 - 02.03.26	30 000	EUR	29 890	29 979	0,00
Covestro AG 1.00% 16 - 10.07.21	300 000	EUR	301 528	301 806	0,05
Covestro AG 1.375% 20 - 06.12.30	40 000	EUR	39 735	39 915	0,01
Covestro AG 1.75% 16 - 25.09.24	200 000	EUR	209 120	208 894	0,03
CRH Finance Germany GmbH 1.75% 14 - 16.07.21	300 000	EUR	303 036	303 375	0,05
Daimler AG Zero Coupon 19 - 02.08.24	225 000	EUR	221 669	216 464	0,04
Daimler AG 0.375% 19 - 11.08.26	200 000	EUR	201 117	188 746	0,03
Daimler AG 0.375% 19 - 11.08.26	200 000	EUR	190 625	188 746	0,03
Daimler AG 0.75% 16 - 05.11.23	300 000	EUR	305 422	301 101	0,05
Daimler AG 0.75% 19 - 02.08.30	250 000	EUR	245 298	230 933	0,04
Daimler AG 0.85% 17 - 28.02.25	82 000	EUR	83 883	80 959	0,01
Daimler AG 0.85% 17 - 28.02.25	350 000	EUR	353 144	345 555	0,06
Daimler AG 1.00% 17 - 15.11.27	430 000	EUR	419 607	416 859	0,07
Daimler AG 1.125% 19 - 08.08.34	270 000	EUR	269 119	249 477	0,04
Daimler AG 1.125% 19 - 11.06.31	240 000	EUR	238 144	228 598	0,04
Daimler AG 1.125% 19 - 11.06.31	100 000	EUR	94 884	95 249	0,02
Daimler AG 1.375% 16 - 05.11.28	350 000	EUR	359 804	351 022	0,06
Daimler AG 1.40% 16 - 01.12.24	320 000	EUR	322 215	325 136	0,05
Daimler AG 1.40% 16 - 01.12.24	100 000	EUR	104 270	101 605	0,02
Daimler AG 1.50% 16 - 03.09.26	307 000	EUR	322 922	312 032	0,05
Daimler AG 1.50% 17 - 07.03.29	520 000	EUR	525 350	525 377	0,09
Daimler AG 1.625% 20 - 22.08.23	330 000	EUR	334 995	337 220	0,06
Daimler AG 1.875% 14 - 07.08.24	300 000	EUR	307 541	309 588	0,05
Daimler AG 2.00% 13 - 25.06.21	250 000	EUR	254 768	254 550	0,04
Daimler AG 2.00% 19 - 27.02.31	280 000	EUR	290 941	292 508	0,05
Daimler AG 2.00% 20 - 22.08.26	380 000	EUR	390 360	395 945	0,07

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Daimler AG 2.125% 17 - 07.03.37	440 000	EUR	453 865	459 070	0,08
Daimler AG 2.25% 14 - 24.01.22	250 000	EUR	259 247	257 552	0,04
Daimler AG 2.375% 12 - 09.12.22	200 000	EUR	209 905	208 042	0,03
Daimler AG 2.375% 13 - 03.08.23	200 000	EUR	211 142	209 038	0,04
Daimler AG 2.375% 20 - 22.05.30	370 000	EUR	392 817	391 371	0,07
Daimler AG 2.625% 20 - 04.07.25	398 000	EUR	423 551	423 759	0,07
Daimler AG 2.625% 20 - 04.07.25	100 000	EUR	108 691	106 472	0,02
Deutsche Bank AG 1.125% 15 - 17.03.25	300 000	EUR	298 114	293 667	0,05
Deutsche Bank AG 1.125% 18 - 30.08.23	200 000	EUR	201 512	204 360	0,03
Deutsche Bank AG 1.25% 14 - 09.08.21	300 000	EUR	300 569	300 396	0,05
Deutsche Bank AG 1.50% 17 - 20.01.22	400 000	EUR	400 958	401 460	0,07
Deutsche Bank AG 1.625% 20 - 20.01.27	1 300 000	EUR	1 284 412	1 286 662	0,22
Deutsche Bank AG 1.75% 18 - 17.01.28	900 000	EUR	866 889	895 527	0,15
Deutsche Bank AG 1.875% 19 - 14.02.22	500 000	EUR	506 728	503 795	0,08
Deutsche Bank AG 2.375% 13 - 01.11.23	500 000	EUR	502 938	511 315	0,09
Deutsche Bank AG 2.625% 19 - 02.12.26	400 000	EUR	417 494	418 780	0,07
Deutsche Boerse AG 1.125% 18 - 26.03.28	100 000	EUR	102 127	107 670	0,02
Deutsche Boerse AG 1.625% 15 - 10.08.25	212 000	EUR	231 257	231 483	0,04
Deutsche Boerse AG 2.375% 12 - 10.05.22	50 000	EUR	52 526	52 604	0,01
Deutsche Boerse AG 2.375% 12 - 10.05.22	250 000	EUR	263 293	263 020	0,04
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.125% 19 - 09.05.24	300 000	EUR	292 073	291 054	0,05
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.625% 18 - 23.02.22	300 000	EUR	302 178	296 823	0,05
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.75% 19 - 02.07.23	100 000	EUR	99 427	99 934	0,02
Deutsche Post AG 0.375% 20 - 20.05.26	230 000	EUR	229 509	231 615	0,04
Deutsche Post AG 0.75% 20 - 20.05.29	230 000	EUR	231 305	235 971	0,04
Deutsche Post AG 1.00% 17 - 13.12.27	150 000	EUR	155 851	157 518	0,03
Deutsche Post AG 1.00% 20 - 20.05.32	330 000	EUR	335 299	340 639	0,06
Deutsche Post AG 1.25% 16 - 04.01.26	150 000	EUR	159 598	159 134	0,03
Deutsche Post AG 1.625% 18 - 12.05.28	300 000	EUR	326 363	329 310	0,06
Deutsche Post AG 2.75% 13 - 10.09.23	200 000	EUR	219 524	219 288	0,04
Deutsche Post AG 2.875% 12 - 12.11.24	270 000	EUR	296 252	303 072	0,05
Deutsche Wohnen SE 1.00% 20 - 30.04.25	200 000	EUR	202 562	204 522	0,03
Deutsche Wohnen SE 1.50% 20 - 30.04.30	200 000	EUR	203 410	210 938	0,04
DVB Bank SE 1.00% 17 - 25.04.22	100 000	EUR	101 038	99 906	0,02
DVB Bank SE 1.25% 16 - 15.09.21	200 000	EUR	199 193	200 972	0,03
DVB Bank SE 1.25% 16 - 16.06.23	100 000	EUR	102 786	100 264	0,02
Eurogrid GmbH 1.113% 20 - 15.05.32	200 000	EUR	206 663	210 560	0,04
Eurogrid GmbH 1.50% 16 - 18.04.28	200 000	EUR	211 570	216 320	0,04
Eurogrid GmbH 1.625% 15 - 11.03.23	200 000	EUR	209 117	209 122	0,04
Eurogrid GmbH 1.875% 15 - 06.10.25	200 000	EUR	213 684	216 014	0,04
Evonik Industries AG 0.625% 20 - 18.09.25	200 000	EUR	200 850	201 954	0,03
Evonik Industries AG 1.00% 15 - 23.01.23	350 000	EUR	359 045	356 657	0,06
Evonik Industries AG FRN 17 - 07.07.77	200 000	EUR	196 839	196 634	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 0.25% 19 - 29.11.23	251 000	EUR	249 238	249 404	0,04
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 0.625% 19 - 30.11.26	158 000	EUR	159 317	157 867	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.00% 20 - 29.05.26	300 000	EUR	302 207	305 121	0,05
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.25% 19 - 29.11.29	150 000	EUR	150 212	154 050	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 18 - 07.11.25	200 000	EUR	202 070	209 958	0,04
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 20 - 29.05.30	300 000	EUR	303 409	309 831	0,05
Hannover Rueck SE 1.125% 18 - 18.04.28	200 000	EUR	211 068	213 972	0,04
Hannover Rueck SE FRN 19 - 10.09.39	200 000	EUR	198 356	191 214	0,03
Hannover Rueck SE FRN 19 - 10.09.39	100 000	EUR	99 548	95 607	0,02
Hannover Rueck SE FRN 20 - 10.08.40	200 000	EUR	198 542	199 054	0,03
Hannover Rueck SE FRN 14 - 29.06.49	200 000	EUR	218 787	215 434	0,04
HeidelbergCement AG 1.50% 16 - 02.07.25	392 000	EUR	400 314	399 393	0,07
HeidelbergCement AG 2.25% 16 - 30.03.23	350 000	EUR	364 290	362 600	0,06
HeidelbergCement AG 2.25% 16 - 06.03.24	164 000	EUR	170 254	172 075	0,03
Hella GmbH & Co. KGaA 0.50% 19 - 26.01.27	200 000	EUR	199 568	186 820	0,03
Henkel AG & Co. KGaA Zero Coupon 16 - 13.09.21	250 000	EUR	250 273	250 142	0,04
Infineon Technologies AG 0.75% 20 - 24.06.23	100 000	EUR	99 833	100 504	0,02
Infineon Technologies AG 1.125% 20 - 24.06.26	100 000	EUR	99 433	100 359	0,02
Infineon Technologies AG 1.50% 15 - 03.10.22	200 000	EUR	203 293	203 294	0,03
Infineon Technologies AG 1.625% 20 - 24.06.29	100 000	EUR	99 076	100 013	0,02
Knorr-Bremse AG 0.50% 16 - 12.08.21	100 000	EUR	99 353	100 069	0,02
Knorr-Bremse AG 1.125% 18 - 13.06.25	300 000	EUR	311 403	313 749	0,05
LANXESS AG 0.25% 16 - 10.07.21	150 000	EUR	150 218	150 086	0,03
LANXESS AG 1.00% 16 - 10.07.26	250 000	EUR	255 656	256 260	0,04
LANXESS AG 1.125% 18 - 16.05.25	100 000	EUR	102 954	102 915	0,02
LANXESS AG 2.625% 12 - 21.11.22	100 000	EUR	106 034	105 587	0,02
LEG Immobilien AG 0.875% 19 - 28.11.27	200 000	EUR	199 770	199 236	0,03
LEG Immobilien AG 1.25% 17 - 23.01.24	200 000	EUR	201 460	203 692	0,03
LEG Immobilien AG 1.625% 19 - 28.11.34	100 000	EUR	100 932	100 128	0,02
Merck Financial Services GmbH 0.005% 19 - 15.12.23	300 000	EUR	299 699	298 722	0,05
Merck Financial Services GmbH 0.125% 20 - 16.07.25	200 000	EUR	199 451	199 080	0,03
Merck Financial Services GmbH 0.375% 19 - 07.05.27	300 000	EUR	301 080	301 668	0,05
Merck Financial Services GmbH 0.50% 20 - 16.07.28	300 000	EUR	302 768	301 023	0,05
Merck Financial Services GmbH 0.875% 19 - 07.05.31	200 000	EUR	204 147	205 246	0,03
Merck Financial Services GmbH 1.375% 15 - 09.01.22	50 000	EUR	51 060	51 183	0,01
Merck Financial Services GmbH 1.375% 15 - 09.01.22	90 000	EUR	92 824	92 129	0,02
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	200 000	EUR	204 186	198 812	0,03
Merck KGaA FRN 14 - 12.12.74	351 000	EUR	355 035	352 551	0,06
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	400 000	EUR	417 263	417 176	0,07
Merck KGaA FRN 14 - 12.12.74	180 000	EUR	196 825	193 549	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Muenchener Hypothekenbank eG 0.50% 19 - 06.08.26	100 000	EUR	101 139	97 258	0,02
Muenchener Hypothekenbank eG 0.625% 15 - 02.10.22	100 000	EUR	100 715	100 135	0,02
Muenchener Hypothekenbank eG 0.875% 17 - 07.11.24	100 000	EUR	103 075	101 056	0,02
Muenchener Hypothekenbank eG 0.875% 18 - 09.12.25	100 000	EUR	102 728	101 411	0,02
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 18 - 26.05.49	500 000	EUR	562 324	570 215	0,10
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 12 - 26.05.42	300 000	EUR	343 504	329 616	0,06
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 18 - 07.05.25	200 000	EUR	206 793	209 962	0,04
Robert Bosch GmbH 1.75% 14 - 07.08.24	200 000	EUR	212 413	214 072	0,04
Santander Consumer Bank AG 0.25% 19 - 15.10.24	200 000	EUR	200 013	196 538	0,03
Santander Consumer Bank AG 0.75% 17 - 17.10.22	200 000	EUR	202 785	200 154	0,03
SAP SE Zero Coupon 20 - 17.05.23	100 000	EUR	100 046	100 096	0,02
SAP SE 0.125% 20 - 18.05.26	200 000	EUR	199 730	200 250	0,03
SAP SE 0.25% 18 - 03.10.22	400 000	EUR	402 141	401 952	0,07
SAP SE 0.375% 20 - 18.05.29	400 000	EUR	400 360	400 672	0,07
SAP SE 0.75% 18 - 12.10.24	300 000	EUR	309 206	309 330	0,05
SAP SE 1.00% 15 - 04.01.25	170 000	EUR	176 057	177 585	0,03
SAP SE 1.00% 18 - 13.03.26	200 000	EUR	209 605	210 114	0,04
SAP SE 1.125% 14 - 20.02.23	100 000	EUR	103 362	102 785	0,02
SAP SE 1.125% 14 - 20.02.23	399 000	EUR	408 393	410 112	0,07
SAP SE 1.25% 18 - 03.10.28	300 000	EUR	312 442	322 980	0,05
SAP SE 1.375% 18 - 13.03.30	200 000	EUR	206 912	218 896	0,04
SAP SE 1.625% 18 - 03.10.31	500 000	EUR	544 099	560 440	0,09
SAP SE 1.75% 14 - 22.02.27	300 000	EUR	329 629	329 877	0,06
Schaeffler AG 1.125% 19 - 26.03.22	199 000	EUR	193 859	193 157	0,03
Schaeffler AG 1.875% 19 - 26.03.24	412 000	EUR	392 092	399 566	0,07
Schaeffler AG 2.875% 19 - 26.03.27	123 000	EUR	114 792	121 980	0,02
Talanx AG FRN 17 - 12.05.47	300 000	EUR	300 494	307 248	0,05
Talanx AG 2.50% 14 - 23.07.26	100 000	EUR	111 845	113 479	0,02
Talanx AG 2.50% 14 - 23.07.26	100 000	EUR	113 242	113 479	0,02
Talanx AG 3.125% 13 - 13.02.23	100 000	EUR	108 761	107 953	0,02
Talanx AG 3.125% 13 - 13.02.23	200 000	EUR	216 295	215 906	0,04
TLG Immobilien AG 0.375% 19 - 23.09.22	200 000	EUR	200 851	196 520	0,03
TLG Immobilien AG 1.50% 19 - 28.05.26	200 000	EUR	194 198	200 012	0,03
Wirecard AG 0.50% 19 - 09.11.24	100 000	EUR	94 747	19 126	0,00
WPP Finance Deutschland GmbH 1.625% 15 - 23.03.30	200 000	EUR	192 018	192 450	0,03
			47 676 814	47 587 471	8,07
Guernesey					
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1.25% 15 - 14.04.22	900 000	EUR	911 602	915 228	0,16

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Guernesey (suite)					
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2.875% 17 - 20.06.22	300 000	EUR	304 185	300 144	0,05
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3.00% 18 - 29.03.25	200 000	EUR	207 231	200 808	0,03
			1 423 018	1 416 180	0,24
Irlande					
Abbott Ireland Financing DAC 0.10% 19 - 19.11.24	200 000	EUR	199 620	198 916	0,03
Abbott Ireland Financing DAC 0.375% 19 - 19.11.27	200 000	EUR	198 820	199 738	0,03
Abbott Ireland Financing DAC 0.875% 18 - 27.09.23	400 000	EUR	409 805	409 264	0,07
Abbott Ireland Financing DAC 1.50% 18 - 27.09.26	400 000	EUR	428 994	427 612	0,07
AIB Group PLC 1.25% 19 - 28.05.24	170 000	EUR	170 894	169 968	0,03
AIB Group PLC 1.50% 18 - 29.03.23	200 000	EUR	199 159	202 196	0,03
AIB Group PLC 2.25% 18 - 07.03.25	200 000	EUR	207 297	210 160	0,04
Aquarius & Investments PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. FRN 13 - 10.02.43	400 000	EUR	449 832	436 232	0,07
Atlas Copco Finance DAC 0.125% 19 - 09.03.29	100 000	EUR	98 303	96 963	0,02
Cloverie PLC for Swiss Reinsurance Co. Ltd. FRN 12 - 09.01.42	200 000	EUR	234 351	224 674	0,04
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 1.50% 18 - 15.12.28	150 000	EUR	155 800	160 463	0,03
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 1.75% 14 - 16.09.24	200 000	EUR	210 200	212 680	0,04
CRH Finance Dac 1.375% 16 - 18.10.28	200 000	EUR	206 046	210 576	0,04
CRH Finance Dac 3.125% 13 - 04.03.23	300 000	EUR	323 454	322 491	0,05
CRH SMW Finance DAC 1.25% 20 - 11.05.26	330 000	EUR	335 038	341 279	0,06
Dell Bank International Dac 0.625% 19 - 17.10.22	300 000	EUR	295 919	296 229	0,05
Eaton Capital Unlimited Co. 0.697% 19 - 14.05.25	200 000	EUR	201 240	200 450	0,03
Eaton Capital Unlimited Co. 0.75% 16 - 20.09.24	100 000	EUR	102 127	100 474	0,02
Grenke Finance PLC 0.625% 19 - 01.09.25	200 000	EUR	193 209	188 992	0,03
Grenke Finance PLC 1.50% 18 - 10.05.23	100 000	EUR	95 947	99 392	0,02
Grenke Finance PLC 1.625% 19 - 04.05.24	100 000	EUR	101 231	99 208	0,02
Johnson Controls International PLC 1.00% 17 - 15.09.23	320 000	EUR	320 563	323 392	0,05
Johnson Controls International PLC 1.375% 16 - 25.02.25	200 000	EUR	203 553	204 748	0,03
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 0.625% 19 - 20.09.29	250 000	EUR	247 077	242 512	0,04
Kerry Group Financial Services Unltd. Co. 2.375% 15 - 09.10.25	217 000	EUR	234 863	239 193	0,04
PartnerRe Ireland Finance DAC 1.25% 16 - 15.09.26	200 000	EUR	197 576	202 522	0,03
Willow No 2 Ireland PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 3.375% 12 - 27.06.22	200 000	EUR	212 305	212 458	0,04
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 1.625% 19 - 17.06.39	200 000	EUR	207 450	222 126	0,04
			6 440 673	6 454 908	1,09
Italie					
Aeroporti di Roma SpA 1.625% 17 - 06.08.27	200 000	EUR	186 746	190 612	0,03
Assicurazioni Generali SpA 2.124% 19 - 10.01.30	200 000	EUR	201 399	192 484	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Assicurazioni Generali SpA 3.875% 19 - 29.01.29	200 000	EUR	216 636	216 164	0,04
Assicurazioni Generali SpA 4.125% 14 - 05.04.26	400 000	EUR	432 835	437 476	0,07
Assicurazioni Generali SpA FRN 16 - 06.08.48	350 000	EUR	382 676	390 365	0,07
Assicurazioni Generali SpA 5.125% 09 - 16.09.24	633 000	EUR	753 974	755 827	0,13
Assicurazioni Generali SpA FRN 15 - 27.10.47	450 000	EUR	526 935	513 157	0,09
Assicurazioni Generali SpA FRN 12 - 12.12.42	300 000	EUR	349 018	346 392	0,06
Assicurazioni Generali SpA FRN 12 - 07.10.42	100 000	EUR	126 173	116 992	0,02
Buzzi Unicem SpA 2.125% 16 - 28.04.23	160 000	EUR	164 592	165 219	0,03
Eni SpA 0.625% 16 - 19.09.24	300 000	EUR	300 090	301 932	0,05
Eni SpA 0.625% 20 - 23.01.30	174 000	EUR	175 319	169 744	0,03
Eni SpA 0.625% 20 - 23.01.30	200 000	EUR	198 642	195 108	0,03
Eni SpA 0.75% 16 - 17.05.22	300 000	EUR	302 675	302 292	0,05
Eni SpA 1.00% 17 - 14.03.25	200 000	EUR	207 508	204 756	0,03
Eni SpA 1.00% 19 - 10.11.34	320 000	EUR	308 672	317 213	0,05
Eni SpA 1.125% 16 - 19.09.28	200 000	EUR	207 787	205 828	0,03
Eni SpA 1.25% 20 - 18.05.26	410 000	EUR	418 722	424 715	0,07
Eni SpA 1.50% 15 - 02.02.26	321 000	EUR	340 088	336 800	0,06
Eni SpA 1.50% 17 - 17.01.27	300 000	EUR	308 851	316 149	0,05
Eni SpA 1.625% 16 - 17.05.28	350 000	EUR	360 684	373 965	0,06
Eni SpA 1.75% 15 - 18.01.24	200 000	EUR	211 698	210 160	0,04
Eni SpA 2.00% 20 - 18.05.31	310 000	EUR	322 774	342 237	0,06
Eni SpA 2.625% 13 - 22.11.21	200 000	EUR	207 237	206 582	0,04
Eni SpA 3.25% 13 - 07.10.23	400 000	EUR	437 583	436 180	0,07
Eni SpA 3.625% 14 - 29.01.29	300 000	EUR	369 347	368 646	0,06
Eni SpA 3.75% 13 - 09.12.25	400 000	EUR	458 099	466 936	0,08
ERG SpA 1.875% 19 - 04.11.25	150 000	EUR	151 865	156 201	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 19 - 12.04.24	200 000	EUR	201 571	197 334	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 0.875% 17 - 27.06.22	100 000	EUR	100 275	100 106	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 07.04.24	508 000	EUR	513 378	505 287	0,09
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 19.11.26	510 000	EUR	500 620	498 724	0,08
Intesa Sanpaolo SpA 1.125% 15 - 03.04.22	600 000	EUR	604 356	603 642	0,10
Intesa Sanpaolo SpA 1.375% 17 - 18.01.24	300 000	EUR	300 864	302 580	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 18 - 20.03.28	500 000	EUR	500 605	506 845	0,09
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 19 - 07.04.29	300 000	EUR	303 363	301 014	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 2.00% 14 - 18.06.21	400 000	EUR	404 690	406 240	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 18 - 30.08.23	400 000	EUR	412 477	415 064	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 20 - 26.05.25	500 000	EUR	510 995	519 900	0,09
Intesa Sanpaolo SpA 3.50% 14 - 17.01.22	300 000	EUR	312 913	313 317	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 13 - 30.10.23	450 000	EUR	490 542	493 497	0,08
Iren SpA 0.875% 16 - 11.04.24	100 000	EUR	100 071	101 907	0,02
Iren SpA 0.875% 19 - 14.10.29	200 000	EUR	195 920	201 752	0,03
Iren SpA 1.00% 20 - 07.01.30	100 000	EUR	98 144	98 540	0,02
Iren SpA 1.50% 17 - 24.10.27	200 000	EUR	207 019	212 736	0,04
Iren SpA 1.95% 18 - 19.09.25	200 000	EUR	202 676	214 806	0,04
Iren SpA 2.75% 15 - 11.02.22	150 000	EUR	159 427	157 983	0,03
Italgas SpA 0.25% 20 - 24.06.25	100 000	EUR	99 208	99 273	0,02
Italgas SpA 0.875% 19 - 24.04.30	200 000	EUR	197 375	202 098	0,03
Italgas SpA 1.00% 19 - 12.11.31	200 000	EUR	203 388	203 450	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italgas SpA 1.125% 17 - 14.03.24	200 000	EUR	204 534	206 376	0,03
Italgas SpA 1.625% 17 - 19.01.27	200 000	EUR	209 417	214 080	0,04
Italgas SpA 1.625% 17 - 18.01.29	300 000	EUR	314 619	323 181	0,05
Snam SpA Zero Coupon 19 - 05.12.24	200 000	EUR	197 815	197 758	0,03
Snam SpA 0.75% 20 - 17.06.30	150 000	EUR	149 785	151 443	0,03
Snam SpA 0.875% 16 - 25.10.26	500 000	EUR	500 640	514 175	0,09
Snam SpA 1.00% 18 - 18.09.23	300 000	EUR	304 071	306 468	0,05
Snam SpA 1.00% 19 - 09.12.34	200 000	EUR	195 214	201 596	0,03
Snam SpA 1.25% 17 - 25.01.25	100 000	EUR	99 148	103 995	0,02
Snam SpA 1.25% 19 - 28.08.25	200 000	EUR	206 045	208 188	0,04
Snam SpA 1.375% 17 - 25.10.27	200 000	EUR	203 353	213 054	0,04
Snam SpA 3.25% 14 - 22.01.24	100 000	EUR	112 100	110 695	0,02
Snam SpA 5.25% 12 - 19.09.22	100 000	EUR	111 119	111 518	0,02
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 0.125% 19 - 25.07.25	300 000	EUR	292 861	296 871	0,05
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 0.875% 15 - 02.02.22	400 000	EUR	404 207	403 500	0,07
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 16 - 10.11.28	200 000	EUR	205 756	206 560	0,04
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 18 - 23.07.23	430 000	EUR	439 349	439 086	0,07
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 19 - 04.10.26	100 000	EUR	100 513	103 022	0,02
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.375% 17 - 26.07.27	400 000	EUR	407 658	424 768	0,07
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 4.90% 04 - 28.10.24	250 000	EUR	300 120	299 115	0,05
UniCredit SpA 0.50% 19 - 04.09.25	400 000	EUR	385 906	385 560	0,07
UniCredit SpA 1.00% 18 - 18.01.23	500 000	EUR	496 097	493 795	0,08
UniCredit SpA FRN 20 - 20.01.26	593 000	EUR	586 335	568 598	0,10
UniCredit SpA FRN 19 - 25.06.25	400 000	EUR	398 164	399 884	0,07
UniCredit SpA FRN 20 - 16.06.26	120 000	EUR	119 479	119 707	0,02
UniCredit SpA FRN 19 - 07.03.25	250 000	EUR	249 612	245 165	0,04
UniCredit SpA 1.80% 20 - 20.01.30	250 000	EUR	249 092	240 788	0,04
UniCredit SpA 2.00% 16 - 03.04.23	300 000	EUR	310 407	309 363	0,05
UniCredit SpA 2.125% 16 - 24.10.26	400 000	EUR	416 875	419 796	0,07
Unione di Banche Italiane SpA 0.75% 17 - 17.10.22	300 000	EUR	293 577	299 049	0,05
Unione di Banche Italiane SpA 1.00% 19 - 22.07.22	200 000	EUR	201 090	199 440	0,03
Unione di Banche Italiane SpA 1.50% 19 - 04.10.24	100 000	EUR	101 320	101 380	0,02
			24 014 780	24 134 201	4,09
Japon					
Mercedes-Benz Finance Co. Ltd. Zero Coupon 19 - 21.08.22	200 000	EUR	199 825	197 600	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.68% 18 - 26.01.23	200 000	EUR	202 580	201 946	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.848% 19 - 19.07.29	200 000	EUR	208 207	199 664	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.872% 17 - 09.07.24	300 000	EUR	304 892	304 056	0,05
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.98% 18 - 10.09.23	200 000	EUR	201 974	203 830	0,04
MUFG Bank Ltd. 0.875% 15 - 03.11.22	200 000	EUR	202 296	202 730	0,03
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 1.00% 15 - 19.01.22	257 000	EUR	260 568	260 452	0,04
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2.75% 13 - 24.07.23	200 000	EUR	215 031	215 896	0,04
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.465% 19 - 30.05.24	300 000	EUR	298 546	299 889	0,05
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.606% 17 - 18.01.22	100 000	EUR	100 887	100 347	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.632% 19 - 23.10.29	400 000	EUR	394 059	388 972	0,07
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.819% 18 - 23.07.23	200 000	EUR	203 403	203 072	0,04
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.934% 17 - 10.11.24	145 000	EUR	147 390	147 848	0,03
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.413% 17 - 14.06.27	200 000	EUR	210 596	211 718	0,04
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.546% 16 - 15.06.26	450 000	EUR	458 657	481 280	0,08
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0.75% 20 - 07.09.27	190 000	EUR	189 962	190 927	0,03
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.00% 20 - 07.09.29	230 000	EUR	229 547	230 561	0,04
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.125% 18 - 21.11.22	580 000	EUR	591 550	590 283	0,10
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.375% 20 - 07.09.32	200 000	EUR	199 780	201 250	0,03
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.00% 20 - 07.09.40	190 000	EUR	188 670	189 958	0,03
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.25% 18 - 21.11.26	550 000	EUR	598 098	602 431	0,10
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.00% 18 - 21.11.30	500 000	EUR	563 105	587 025	0,10
			6 169 623	6 211 735	1,05
Jersey					
Aptiv PLC 1.50% 15 - 03.10.25	300 000	EUR	293 993	298 299	0,05
Aptiv PLC 1.60% 16 - 15.09.28	100 000	EUR	101 665	96 585	0,02
Atrium European Real Estate Ltd. 3.00% 18 - 09.11.25	100 000	EUR	106 539	96 548	0,02
Atrium European Real Estate Ltd. 3.625% 14 - 17.10.22	165 000	EUR	173 481	167 072	0,03
Glencore Finance Europe Ltd. 0.625% 19 - 09.11.24	180 000	EUR	171 162	173 075	0,03
Glencore Finance Europe Ltd. 1.50% 19 - 15.10.26	150 000	EUR	145 969	147 060	0,03
Glencore Finance Europe Ltd. 1.625% 14 - 18.01.22	420 000	EUR	420 262	421 353	0,07
Glencore Finance Europe Ltd. 1.75% 15 - 17.03.25	230 000	EUR	229 045	230 927	0,04
Glencore Finance Europe Ltd. 1.875% 16 - 13.09.23	310 000	EUR	310 956	313 754	0,05
Glencore Finance Europe Ltd. 3.75% 14 - 04.01.26	250 000	EUR	275 881	276 958	0,05
Heathrow Funding Ltd. 1.50% 15 - 02.11.30	200 000	EUR	213 112	200 536	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 14 - 23.05.22	320 000	EUR	323 248	325 302	0,06
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 17 - 07.12.32	200 000	EUR	213 748	203 448	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 19 - 14.03.34	250 000	EUR	254 498	252 960	0,04
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3.25% 15 - 11.12.25	200 000	EUR	187 774	189 498	0,03
			3 421 333	3 393 375	0,58

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Corée					
LG Chem Ltd. 0.50% 19 - 15.04.23	100 000	EUR	100 683	98 423	0,02
POSCO 0.50% 20 - 17.01.24	237 000	EUR	229 977	228 714	0,04
Shinhan Bank Co. Ltd. 0.25% 19 - 16.10.24	200 000	EUR	196 043	193 094	0,03
			526 703	520 231	0,09
Luxembourg					
Banque Internationale a Luxembourg SA 1.50% 18 - 28.09.23	100 000	EUR	102 491	99 561	0,02
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.632% 19 - 06.04.23	130 000	EUR	130 102	129 162	0,02
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.632% 19 - 06.04.23	100 000	EUR	100 908	99 355	0,02
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 19 - 06.04.26	400 000	EUR	401 791	401 404	0,07
CNH Industrial Finance Europe SA 1.375% 17 - 23.05.22	200 000	EUR	199 464	200 818	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 1.625% 19 - 07.03.29	100 000	EUR	100 845	94 889	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 17 - 09.12.25	200 000	EUR	207 765	201 992	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 19 - 25.03.27	350 000	EUR	340 167	342 804	0,06
CNH Industrial Finance Europe SA 1.875% 18 - 19.01.26	200 000	EUR	205 681	198 806	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 2.875% 16 - 17.05.23	200 000	EUR	209 375	210 404	0,04
GELF Bond Issuer I SA 0.875% 16 - 20.10.22	200 000	EUR	198 772	199 710	0,03
GELF Bond Issuer I SA 1.125% 19 - 18.07.29	200 000	EUR	203 135	191 630	0,03
Grand City Properties SA 1.375% 17 - 08.03.26	200 000	EUR	197 027	205 894	0,03
Grand City Properties SA 1.50% 15 - 17.04.25	200 000	EUR	203 154	206 722	0,03
Grand City Properties SA 1.50% 18 - 22.02.27	300 000	EUR	307 655	310 569	0,05
Grand City Properties SA 1.70% 20 - 04.09.24	300 000	EUR	305 327	311 742	0,05
Grand City Properties SA FRN 18 - 31.12.99	100 000	EUR	98 661	98 273	0,02
Grand City Properties SA FRN 15 - 29.12.49	100 000	EUR	99 930	101 917	0,02
Hannover Finance Luxembourg SA FRN 12 - 30.06.43	200 000	EUR	227 884	223 290	0,04
Harman Finance International SCA 2.00% 15 - 27.05.22	100 000	EUR	102 960	101 284	0,02
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 0.50% 18 - 08.09.22	200 000	EUR	201 188	198 404	0,03
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.125% 19 - 12.01.27	250 000	EUR	252 834	246 952	0,04
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.50% 17 - 14.06.27	200 000	EUR	200 517	202 724	0,03
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.625% 17 - 04.07.26	350 000	EUR	351 574	358 186	0,06
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.75% 18 - 24.04.28	300 000	EUR	308 984	306 468	0,05
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 2.50% 20 - 10.09.24	323 000	EUR	335 998	342 674	0,06

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Luxembourg (suite)					
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 3.25% 13 - 21.10.21	100 000	EUR	104 064	103 311	0,02
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 19 - 29.11.26	150 000	EUR	148 807	147 660	0,02
Holcim Finance Luxembourg SA 1.375% 16 - 26.05.23	268 000	EUR	276 630	274 204	0,05
Holcim Finance Luxembourg SA 1.75% 17 - 29.08.29	300 000	EUR	298 507	317 682	0,05
Holcim Finance Luxembourg SA 2.25% 16 - 26.05.28	400 000	EUR	436 027	441 236	0,07
Holcim Finance Luxembourg SA 2.375% 20 - 04.09.25	200 000	EUR	208 056	215 022	0,04
Holcim Finance Luxembourg SA 3.00% 14 - 22.01.24	100 000	EUR	107 753	108 378	0,02
John Deere Cash Management SA 0.50% 17 - 15.09.23	100 000	EUR	101 775	100 808	0,02
John Deere Cash Management SA 1.375% 20 - 04.02.24	321 000	EUR	323 576	333 326	0,06
John Deere Cash Management SA 1.65% 19 - 13.06.39	200 000	EUR	214 387	213 650	0,04
John Deere Cash Management SA 1.85% 20 - 04.02.28	266 000	EUR	274 762	288 019	0,05
John Deere Cash Management SA 2.20% 20 - 04.02.32	266 000	EUR	280 296	301 583	0,05
Medtronic Global Holdings SCA Zero Coupon 19 - 12.02.22	300 000	EUR	294 799	298 116	0,05
Medtronic Global Holdings SCA 0.25% 19 - 07.02.25	274 000	EUR	265 813	272 655	0,05
Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 19 - 03.07.23	550 000	EUR	546 021	551 111	0,09
Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 19 - 07.02.31	374 000	EUR	358 650	384 139	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 19 - 03.07.27	611 000	EUR	619 199	638 147	0,11
Medtronic Global Holdings SCA 1.50% 19 - 07.02.39	374 000	EUR	354 700	374 221	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 1.625% 19 - 03.07.31	374 000	EUR	385 808	407 854	0,07
Medtronic Global Holdings SCA 1.75% 19 - 07.02.49	274 000	EUR	242 468	267 512	0,05
Medtronic Global Holdings SCA 2.25% 19 - 03.07.39	424 000	EUR	449 959	477 242	0,08
Michelin Luxembourg SCS 1.125% 15 - 28.05.22	100 000	EUR	101 921	101 702	0,02
Michelin Luxembourg SCS 1.75% 15 - 28.05.27	100 000	EUR	109 021	109 462	0,02
Nestle Finance International Ltd. Zero Coupon 20 - 11.12.24	200 000	EUR	199 845	200 144	0,03
Nestle Finance International Ltd. 0.125% 20 - 11.12.27	490 000	EUR	487 664	488 496	0,08
Nestle Finance International Ltd. 0.375% 17 - 18.01.24	350 000	EUR	353 648	355 260	0,06
Nestle Finance International Ltd. 0.375% 20 - 05.12.32	270 000	EUR	265 756	266 536	0,05
Nestle Finance International Ltd. 0.75% 14 - 11.08.21	100 000	EUR	100 824	101 028	0,02
Nestle Finance International Ltd. 0.75% 14 - 11.08.21	1 000	EUR	1 014	1 010	0,00
Nestle Finance International Ltd. 0.75% 15 - 16.05.23	100 000	EUR	102 525	102 224	0,02
Nestle Finance International Ltd. 1.125% 20 - 04.01.26	377 000	EUR	392 682	398 402	0,07

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Luxembourg (suite)					
Nestle Finance International Ltd. 1.25% 17 - 11.02.29	200 000	EUR	212 725	220 044	0,04
Nestle Finance International Ltd. 1.25% 17 - 11.02.29	100 000	EUR	109 701	110 022	0,02
Nestle Finance International Ltd. 1.50% 20 - 04.01.30	277 000	EUR	295 372	306 296	0,05
Nestle Finance International Ltd. 1.75% 12 - 09.12.22	326 000	EUR	338 911	338 851	0,06
Nestle Finance International Ltd. 1.75% 17 - 11.02.37	300 000	EUR	348 526	356 712	0,06
Nestle Finance International Ltd. 2.125% 13 - 09.10.21	100 000	EUR	102 839	102 572	0,02
Richemont International Holding SA 0.75% 20 - 26.05.28	300 000	EUR	304 501	308 484	0,05
Richemont International Holding SA 1.00% 18 - 26.03.26	600 000	EUR	627 181	627 678	0,11
Richemont International Holding SA 1.125% 20 - 26.05.32	320 000	EUR	330 323	336 602	0,06
Richemont International Holding SA 1.50% 18 - 26.03.30	400 000	EUR	429 637	437 504	0,07
Richemont International Holding SA 1.625% 20 - 26.05.40	300 000	EUR	304 468	308 409	0,05
Richemont International Holding SA 2.00% 18 - 26.03.38	340 000	EUR	394 106	383 758	0,06
SES SA 0.875% 19 - 11.04.27	200 000	EUR	192 380	185 614	0,03
SES SA 1.625% 18 - 22.03.26	200 000	EUR	204 563	199 626	0,03
SES SA 2.00% 20 - 07.02.28	130 000	EUR	129 279	129 656	0,02
Swiss Re Finance Luxembourg SA FRN 19 - 30.04.50	200 000	EUR	206 564	209 976	0,04
Talanx Finanz Luxembourg SA FRN 12 - 15.06.42	100 000	EUR	121 806	114 147	0,02
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 20 - 14.02.25	200 000	EUR	198 956	191 790	0,03
Tyco Electronics Group SA 1.10% 15 - 03.01.23	150 000	EUR	153 524	152 713	0,03
			19 006 508	19 246 228	3,26
Pays-Bas					
ABN AMRO Bank NV 0.25% 18 - 12.03.21	400 000	EUR	402 319	401 232	0,07
ABN AMRO Bank NV 0.50% 18 - 17.07.23	550 000	EUR	555 847	558 052	0,09
ABN AMRO Bank NV 0.50% 19 - 15.04.26	300 000	EUR	300 767	306 471	0,05
ABN AMRO Bank NV 0.60% 20 - 15.01.27	400 000	EUR	404 514	394 376	0,07
ABN AMRO Bank NV 0.625% 16 - 31.05.22	350 000	EUR	351 541	354 431	0,06
ABN AMRO Bank NV 0.875% 18 - 22.04.25	300 000	EUR	308 323	311 400	0,05
ABN AMRO Bank NV 0.875% 19 - 15.01.24	600 000	EUR	615 247	617 406	0,10
ABN AMRO Bank NV 1.00% 15 - 16.04.25	500 000	EUR	515 333	523 730	0,09
ABN AMRO Bank NV 1.25% 20 - 28.05.25	500 000	EUR	506 887	511 460	0,09
ABN AMRO Bank NV 2.50% 13 - 29.11.23	300 000	EUR	325 489	325 233	0,06
ABN AMRO Bank NV FRN 16 - 18.01.28	300 000	EUR	316 795	311 721	0,05
ABN AMRO Bank NV 4.125% 12 - 28.03.22	381 000	EUR	409 496	408 348	0,07
ABN AMRO Bank NV 7.125% 12 - 07.06.22	305 000	EUR	345 784	343 650	0,06
Achmea Bank NV 1.125% 15 - 25.04.22	330 000	EUR	335 435	333 554	0,06
Achmea BV 1.50% 20 - 26.05.27	300 000	EUR	302 390	307 149	0,05
Achmea BV FRN 15 - 29.12.49	300 000	EUR	318 764	312 876	0,05
Achmea BV FRN 13 - 04.04.43	100 000	EUR	115 507	109 290	0,02
Adecco International Financial Services BV 1.00% 16 - 12.02.24	300 000	EUR	306 275	308 439	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Adecco International Financial Services BV 1.25% 19 - 20.11.29	100 000	EUR	100 635	100 284	0,02
Adecco International Financial Services BV 1.50% 15 - 22.11.22	100 000	EUR	102 468	102 478	0,02
Aegon Bank NV 0.625% 19 - 21.06.24	200 000	EUR	202 849	201 086	0,03
Aegon NV 1.00% 16 - 12.08.23	100 000	EUR	100 956	101 715	0,02
Aegon NV FRN 14 - 25.04.44	300 000	EUR	325 044	315 699	0,05
Akzo Nobel NV 1.125% 16 - 04.08.26	200 000	EUR	205 891	210 220	0,04
Akzo Nobel NV 1.625% 20 - 14.04.30	299 000	EUR	314 576	314 931	0,05
Akzo Nobel NV 1.75% 14 - 11.07.24	100 000	EUR	106 452	106 444	0,02
Akzo Nobel NV 2.625% 12 - 27.07.22	300 000	EUR	316 111	315 801	0,05
Allianz Finance II BV Zero Coupon 20 - 14.01.25	300 000	EUR	300 837	300 225	0,05
Allianz Finance II BV 0.25% 17 - 06.06.23	200 000	EUR	200 756	201 730	0,03
Allianz Finance II BV 0.50% 20 - 14.01.31	200 000	EUR	204 672	201 186	0,03
Allianz Finance II BV 0.50% 20 - 14.01.31	100 000	EUR	99 756	100 593	0,02
Allianz Finance II BV 0.875% 17 - 12.06.27	300 000	EUR	310 102	317 292	0,05
Allianz Finance II BV 0.875% 19 - 15.01.26	300 000	EUR	312 678	313 188	0,05
Allianz Finance II BV 1.375% 16 - 21.04.31	200 000	EUR	210 382	219 060	0,04
Allianz Finance II BV 1.50% 19 - 15.01.30	200 000	EUR	215 051	222 588	0,04
Allianz Finance II BV 3.00% 13 - 13.03.28	300 000	EUR	363 586	368 643	0,06
Allianz Finance II BV 3.50% 12 - 14.02.22	500 000	EUR	528 436	529 170	0,09
Allianz Finance II BV FRN 11 - 07.08.41	400 000	EUR	433 096	418 556	0,07
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 1.125% 18 - 17.09.25	300 000	EUR	313 194	312 516	0,05
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 2.00% 18 - 17.09.30	200 000	EUR	228 883	223 366	0,04
Argentum Netherlands BV for Swiss Life AG FRN 15 - 29.12.49	350 000	EUR	395 279	386 200	0,07
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co. Ltd. FRN 19 - 19.02.49	200 000	EUR	216 001	214 932	0,04
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co. Ltd. FRN 16 - 10.01.46	200 000	EUR	223 430	223 090	0,04
ASML Holding NV 0.25% 20 - 25.02.30	250 000	EUR	247 778	241 083	0,04
ASML Holding NV 0.625% 16 - 07.07.22	100 000	EUR	100 596	101 117	0,02
ASML Holding NV 0.625% 20 - 05.07.29	400 000	EUR	401 732	402 248	0,07
ASML Holding NV 1.375% 16 - 07.07.26	400 000	EUR	421 602	427 632	0,07
ASML Holding NV 1.625% 16 - 28.05.27	200 000	EUR	216 404	217 486	0,04
ASML Holding NV 3.375% 13 - 19.09.23	200 000	EUR	219 891	220 968	0,04
ASR Nederland NV FRN 19 - 05.02.49	200 000	EUR	204 189	207 548	0,04
ASR Nederland NV FRN 14 - 30.09.49	100 000	EUR	111 245	108 997	0,02
ASR Nederland NV FRN 15 - 29.09.45	200 000	EUR	225 121	226 868	0,04
BMW Finance NV Zero Coupon 19 - 24.03.23	400 000	EUR	400 477	396 288	0,07
BMW Finance NV Zero Coupon 20 - 14.04.23	382 000	EUR	381 288	377 813	0,06
BMW Finance NV 0.125% 18 - 29.11.21	400 000	EUR	400 604	400 416	0,07
BMW Finance NV 0.125% 19 - 13.07.22	300 000	EUR	298 836	299 142	0,05
BMW Finance NV 0.125% 19 - 13.07.22	100 000	EUR	100 235	99 714	0,02
BMW Finance NV 0.25% 18 - 14.01.22	200 000	EUR	200 676	200 466	0,03
BMW Finance NV 0.375% 18 - 07.10.23	550 000	EUR	547 206	550 324	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
BMW Finance NV 0.375% 19 - 24.09.27	230 000	EUR	227 730	225 359	0,04
BMW Finance NV 0.375% 20 - 14.01.27	206 000	EUR	207 271	203 658	0,03
BMW Finance NV 0.50% 18 - 22.11.22	400 000	EUR	402 831	402 412	0,07
BMW Finance NV 0.625% 19 - 10.06.23	550 000	EUR	556 165	555 263	0,09
BMW Finance NV 0.75% 16 - 15.04.24	300 000	EUR	302 962	304 737	0,05
BMW Finance NV 0.75% 17 - 07.12.24	200 000	EUR	205 040	203 474	0,03
BMW Finance NV 0.75% 19 - 13.07.26	250 000	EUR	252 566	253 567	0,04
BMW Finance NV 0.875% 17 - 04.03.25	250 000	EUR	256 359	255 647	0,04
BMW Finance NV 0.875% 20 - 14.01.32	20 000	EUR	20 153	20 278	0,00
BMW Finance NV 0.875% 20 - 14.01.32	270 000	EUR	267 846	273 756	0,05
BMW Finance NV 1.00% 15 - 21.01.25	200 000	EUR	206 585	205 764	0,03
BMW Finance NV 1.00% 16 - 15.02.22	400 000	EUR	405 556	405 032	0,07
BMW Finance NV 1.00% 18 - 29.08.25	250 000	EUR	254 600	257 520	0,04
BMW Finance NV 1.00% 18 - 14.11.24	426 000	EUR	428 898	436 765	0,07
BMW Finance NV 1.125% 18 - 01.10.28	300 000	EUR	309 211	311 145	0,05
BMW Finance NV 1.125% 18 - 22.05.26	290 000	EUR	297 382	301 867	0,05
BMW Finance NV 1.25% 14 - 09.05.22	300 000	EUR	304 973	306 687	0,05
BMW Finance NV 1.50% 19 - 02.06.29	550 000	EUR	568 188	577 824	0,10
BMW Finance NV 2.375% 13 - 24.01.23	175 000	EUR	185 074	184 669	0,03
BMW Finance NV 2.625% 14 - 17.01.24	194 000	EUR	211 741	209 728	0,04
Bunge Finance Europe BV 1.85% 16 - 16.06.23	200 000	EUR	202 634	201 470	0,03
Citycon Treasury BV 1.25% 16 - 09.08.26	100 000	EUR	95 804	84 245	0,01
Citycon Treasury BV 2.375% 18 - 15.01.27	100 000	EUR	97 871	87 387	0,01
Citycon Treasury BV 2.50% 14 - 10.01.24	200 000	EUR	196 928	188 594	0,03
Coca-Cola HBC Finance BV 0.625% 19 - 21.11.29	200 000	EUR	191 900	195 668	0,03
Coca-Cola HBC Finance BV 1.00% 19 - 14.05.27	210 000	EUR	212 449	215 376	0,04
Coca-Cola HBC Finance BV 1.625% 19 - 14.05.31	200 000	EUR	204 373	213 242	0,04
Coca-Cola HBC Finance BV 1.875% 16 - 11.11.24	219 000	EUR	232 818	233 447	0,04
Compass Group Finance Netherlands BV 1.50% 18 - 09.05.28	100 000	EUR	106 349	105 567	0,02
Compass Group International BV 0.625% 17 - 07.03.24	350 000	EUR	351 942	353 430	0,06
Conti-Gummi Finance BV 1.125% 20 - 25.09.24	50 000	EUR	49 795	49 960	0,01
Conti-Gummi Finance BV 2.125% 20 - 27.11.23	330 000	EUR	338 405	340 451	0,06
Cooperatieve Rabobank UA 0.125% 16 - 10.11.21	200 000	EUR	200 659	200 770	0,03
Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 19 - 30.10.26	200 000	EUR	198 940	197 020	0,03
Cooperatieve Rabobank UA 0.50% 17 - 12.06.22	250 000	EUR	254 089	253 615	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 0.625% 19 - 27.02.24	500 000	EUR	503 164	505 025	0,09
Cooperatieve Rabobank UA 0.75% 18 - 29.08.23	400 000	EUR	404 531	405 160	0,07
Cooperatieve Rabobank UA FRN 20 - 05.05.28	400 000	EUR	401 484	405 368	0,07
Cooperatieve Rabobank UA 1.125% 19 - 05.07.31	400 000	EUR	407 947	416 672	0,07
Cooperatieve Rabobank UA 1.25% 16 - 23.03.26	750 000	EUR	787 270	801 690	0,14
Cooperatieve Rabobank UA 1.375% 15 - 02.03.27	550 000	EUR	588 862	599 500	0,10
Cooperatieve Rabobank UA 2.375% 13 - 22.05.23	480 000	EUR	512 309	514 315	0,09
Cooperatieve Rabobank UA 3.875% 13 - 25.07.23	200 000	EUR	222 217	219 816	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 3.875% 13 - 25.07.23	200 000	EUR	219 781	219 816	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 4.00% 12 - 01.11.22	729 000	EUR	774 114	774 891	0,13
Cooperatieve Rabobank UA 4.125% 10 - 14.07.25	937 000	EUR	1 119 600	1 132 168	0,19

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Cooperatieve Rabobank UA 4.125% 12 - 14.09.22	400 000	EUR	429 367	433 200	0,07
Cooperatieve Rabobank UA 4.375% 06 - 06.07.21	300 000	EUR	313 052	312 684	0,05
Cooperatieve Rabobank UA 4.75% 07 - 06.06.22	600 000	EUR	657 157	656 166	0,11
Cooperatieve Rabobank UA 4.75% 07 - 06.06.22	350 000	EUR	379 846	382 763	0,07
CRH Funding BV 1.625% 20 - 05.05.30	202 000	EUR	205 554	211 914	0,04
CRH Funding BV 1.875% 15 - 01.09.24	300 000	EUR	312 513	314 718	0,05
Daimler International Finance BV 0.20% 17 - 13.09.21	300 000	EUR	299 707	299 460	0,05
Daimler International Finance BV 0.25% 18 - 05.11.22	50 000	EUR	49 955	49 749	0,01
Daimler International Finance BV 0.25% 18 - 05.11.22	300 000	EUR	299 003	298 491	0,05
Daimler International Finance BV 0.25% 18 - 08.09.21	450 000	EUR	451 247	449 631	0,08
Daimler International Finance BV 0.25% 19 - 11.06.23	430 000	EUR	430 053	419 216	0,07
Daimler International Finance BV 0.25% 19 - 11.06.23	196 000	EUR	194 309	191 084	0,03
Daimler International Finance BV 0.625% 19 - 27.02.23	550 000	EUR	551 404	549 004	0,09
Daimler International Finance BV 0.625% 19 - 05.06.27	240 000	EUR	239 129	227 378	0,04
Daimler International Finance BV 0.625% 19 - 05.06.27	124 000	EUR	124 098	117 479	0,02
Daimler International Finance BV 0.875% 18 - 04.09.24	150 000	EUR	151 279	149 510	0,03
Daimler International Finance BV 0.875% 18 - 04.09.24	200 000	EUR	201 464	199 346	0,03
Daimler International Finance BV 1.00% 18 - 11.11.25	70 000	EUR	69 748	69 385	0,01
Daimler International Finance BV 1.00% 18 - 11.11.25	385 000	EUR	386 935	381 616	0,06
Daimler International Finance BV 1.375% 19 - 26.06.26	302 000	EUR	310 228	303 945	0,05
Daimler International Finance BV 1.50% 18 - 02.09.27	50 000	EUR	51 268	50 492	0,01
Daimler International Finance BV 1.50% 18 - 02.09.27	250 000	EUR	247 554	252 458	0,04
de Volksbank NV 0.01% 19 - 16.09.24	100 000	EUR	99 522	99 169	0,02
de Volksbank NV 0.75% 18 - 25.06.23	300 000	EUR	300 604	303 405	0,05
Deutsche Post Finance BV 2.95% 12 - 27.06.22	350 000	EUR	371 273	372 218	0,06
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG FRN 17 - 29.09.47	200 000	EUR	209 390	212 276	0,04
ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group FRN 16 - 29.12.49	250 000	EUR	290 231	284 935	0,05
ELM BV for Swiss Reinsurance Co. Ltd. FRN 15 - 29.12.49	200 000	EUR	209 031	207 970	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
ELM BV for Swiss Reinsurance Co. Ltd. FRN 15 - 29.12.49	232 000	EUR	247 306	241 245	0,04
Euronext NV 1.00% 18 - 18.04.25	100 000	EUR	102 869	102 677	0,02
Euronext NV 1.125% 19 - 06.12.29	200 000	EUR	201 891	206 256	0,04
Evonik Finance BV 0.375% 16 - 09.07.24	200 000	EUR	200 044	200 904	0,03
Evonik Finance BV 0.75% 16 - 09.07.28	100 000	EUR	99 592	100 710	0,02
EXOR NV 1.75% 18 - 18.01.28	200 000	EUR	208 130	202 956	0,03
EXOR NV 1.75% 19 - 14.10.34	140 000	EUR	139 633	128 871	0,02
EXOR NV 2.125% 15 - 12.02.22	300 000	EUR	311 063	309 342	0,05
EXOR NV 2.25% 20 - 29.04.30	130 000	EUR	131 744	131 274	0,02
EXOR NV 2.50% 14 - 10.08.24	200 000	EUR	213 832	212 554	0,04
Givaudan Finance Europe BV 1.00% 20 - 22.04.27	133 000	EUR	137 007	137 853	0,02
Givaudan Finance Europe BV 1.625% 20 - 22.04.32	233 000	EUR	249 624	250 107	0,04
ING Bank NV Zero Coupon 19 - 04.08.22	500 000	EUR	498 614	498 775	0,08
ING Bank NV 0.375% 18 - 26.11.21	400 000	EUR	402 537	401 668	0,07
ING Bank NV 4.50% 12 - 21.02.22	750 000	EUR	804 584	804 540	0,14
ING Groep NV FRN 19 - 09.03.25	200 000	EUR	199 752	195 628	0,03
ING Groep NV FRN 19 - 09.03.25	200 000	EUR	191 301	195 628	0,03
ING Groep NV 0.75% 17 - 03.09.22	400 000	EUR	402 896	403 352	0,07
ING Groep NV 1.00% 18 - 20.09.23	300 000	EUR	305 353	306 351	0,05
ING Groep NV FRN 19 - 13.11.30	400 000	EUR	393 386	385 568	0,07
ING Groep NV 1.125% 18 - 14.02.25	400 000	EUR	406 698	411 496	0,07
ING Groep NV 1.375% 17 - 01.11.28	300 000	EUR	307 044	318 234	0,05
ING Groep NV FRN 17 - 26.09.29	400 000	EUR	397 573	402 384	0,07
ING Groep NV FRN 18 - 22.03.30	300 000	EUR	306 764	306 618	0,05
ING Groep NV 2.00% 18 - 20.09.28	500 000	EUR	541 583	556 225	0,09
ING Groep NV 2.125% 19 - 01.10.26	300 000	EUR	316 649	326 232	0,06
ING Groep NV FRN 20 - 26.05.31	600 000	EUR	609 309	614 082	0,10
ING Groep NV FRN 17 - 15.02.29	200 000	EUR	210 805	207 970	0,04
ING Groep NV 2.50% 18 - 15.11.30	600 000	EUR	681 030	709 422	0,12
ING Groep NV FRN 17 - 04.11.28	400 000	EUR	420 101	419 552	0,07
innogy Finance BV 0.75% 18 - 30.11.22	300 000	EUR	305 822	303 306	0,05
innogy Finance BV 1.00% 17 - 13.04.25	300 000	EUR	311 333	310 230	0,05
innogy Finance BV 1.25% 17 - 19.10.27	400 000	EUR	417 005	423 104	0,07
innogy Finance BV 1.50% 18 - 31.07.29	469 000	EUR	501 954	502 379	0,09
innogy Finance BV 3.00% 13 - 17.01.24	301 000	EUR	331 907	330 185	0,06
innogy Finance BV 5.75% 03 - 14.02.33	100 000	EUR	159 558	156 507	0,03
innogy Finance BV 6.50% 09 - 08.10.21	100 000	EUR	107 391	106 994	0,02
Innogy Finance BV 1.625% 18 - 30.05.26	300 000	EUR	322 547	322 326	0,05
Koninklijke DSM NV 0.25% 20 - 23.06.28	100 000	EUR	99 654	100 051	0,02
Koninklijke DSM NV 0.625% 20 - 23.06.32	150 000	EUR	148 694	149 864	0,03
Koninklijke DSM NV 0.75% 16 - 28.09.26	300 000	EUR	306 803	311 742	0,05
Koninklijke DSM NV 1.00% 15 - 04.09.25	200 000	EUR	208 258	208 224	0,04
Koninklijke DSM NV 1.375% 15 - 26.09.22	276 000	EUR	285 145	285 036	0,05
Koninklijke DSM NV 2.375% 14 - 04.03.24	100 000	EUR	106 077	108 036	0,02
Koninklijke KPN NV 0.625% 16 - 04.09.25	200 000	EUR	196 718	199 820	0,03
Koninklijke KPN NV 1.125% 16 - 09.11.28	200 000	EUR	201 066	202 888	0,03
Koninklijke KPN NV 4.25% 12 - 03.01.22	300 000	EUR	320 689	320 229	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Koninklijke KPN NV 5.625% 09 - 30.09.24	200 000	EUR	239 227	241 812	0,04
Koninklijke Philips NV 0.50% 17 - 09.06.23	300 000	EUR	303 779	303 567	0,05
Koninklijke Philips NV 0.50% 19 - 22.05.26	220 000	EUR	221 094	222 242	0,04
Koninklijke Philips NV 0.75% 18 - 05.02.24	200 000	EUR	203 605	204 220	0,03
Koninklijke Philips NV 1.375% 18 - 05.02.28	200 000	EUR	210 363	214 970	0,04
Koninklijke Philips NV 1.375% 20 - 30.03.25	138 000	EUR	140 958	144 338	0,02
Koninklijke Philips NV 2.00% 20 - 30.03.30	138 000	EUR	144 286	153 696	0,03
LeasePlan Corp. NV 0.125% 19 - 13.09.23	100 000	EUR	99 205	96 398	0,02
LeasePlan Corp. NV 0.125% 19 - 13.09.23	341 000	EUR	338 339	328 717	0,06
LeasePlan Corp. NV 0.75% 17 - 10.03.22	200 000	EUR	201 767	197 500	0,03
LeasePlan Corp. NV 1.00% 18 - 05.02.23	200 000	EUR	198 386	198 412	0,03
LeasePlan Corp. NV 1.00% 19 - 25.02.22	200 000	EUR	198 522	198 986	0,03
LeasePlan Corp. NV 1.375% 19 - 03.07.24	100 000	EUR	101 887	100 304	0,02
LeasePlan Corp. NV 3.50% 20 - 04.09.25	233 000	EUR	239 605	253 870	0,04
Linde Finance BV 0.25% 17 - 18.01.22	531 000	EUR	533 969	533 708	0,09
Linde Finance BV 0.25% 20 - 19.05.27	300 000	EUR	300 812	302 148	0,05
Linde Finance BV 0.55% 20 - 19.05.32	300 000	EUR	300 701	301 695	0,05
Linde Finance BV 1.00% 16 - 20.04.28	260 000	EUR	274 782	279 105	0,05
Linde Finance BV 1.875% 14 - 22.05.24	100 000	EUR	105 525	107 738	0,02
Linde Finance BV 2.00% 13 - 18.04.23	254 000	EUR	269 119	268 541	0,05
LYB International Finance II BV 0.875% 19 - 17.09.26	200 000	EUR	192 947	191 886	0,03
LYB International Finance II BV 1.625% 19 - 17.09.31	200 000	EUR	208 082	191 400	0,03
LYB International Finance II BV 1.875% 16 - 03.02.22	200 000	EUR	202 498	202 510	0,03
Madrilena Red de Gas Finance BV 1.375% 17 - 04.11.25	200 000	EUR	204 810	206 254	0,04
Madrilena Red de Gas Finance BV 2.25% 17 - 04.11.29	100 000	EUR	111 513	106 236	0,02
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.875% 19 - 10.01.31	300 000	EUR	296 867	300 669	0,05
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.375% 19 - 31.05.23	100 000	EUR	99 390	99 387	0,02
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.375% 19 - 26.02.25	200 000	EUR	199 568	196 990	0,03
Nationale-Nederlanden Levensverzekering Maatschappij NV FRN 12 - 29.08.42	100 000	EUR	126 190	115 930	0,02
Nationale-Nederlanden Levensverzekering Maatschappij NV FRN 12 - 29.08.42	100 000	EUR	122 215	115 930	0,02
NE Property BV 1.75% 17 - 23.11.24	200 000	EUR	174 187	193 632	0,03
NE Property BV 1.875% 19 - 10.09.26	200 000	EUR	192 330	185 972	0,03
NE Property BV 2.625% 19 - 22.05.23	200 000	EUR	197 970	202 280	0,03
NIBC Bank NV 0.875% 19 - 07.08.25	200 000	EUR	198 380	194 720	0,03
NIBC Bank NV 1.125% 18 - 19.04.23	200 000	EUR	200 378	198 910	0,03
NIBC Bank NV 1.50% 17 - 31.01.22	200 000	EUR	204 750	201 746	0,03
NIBC Bank NV 2.00% 19 - 04.09.24	200 000	EUR	200 380	198 856	0,03
NN Group NV 0.875% 17 - 13.01.23	200 000	EUR	203 940	201 938	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
NN Group NV 1.00% 15 - 18.03.22	205 000	EUR	206 500	207 206	0,04
NN Group NV 1.625% 17 - 06.01.27	300 000	EUR	313 286	317 367	0,05
NN Group NV FRN 14 - 29.06.49	300 000	EUR	317 098	321 744	0,05
NN Group NV FRN 14 - 15.07.49	300 000	EUR	323 932	326 649	0,06
NN Group NV FRN 14 - 04.08.44	300 000	EUR	334 154	327 390	0,06
NN Group NV FRN 17 - 13.01.48	300 000	EUR	337 906	340 683	0,06
PACCAR Financial Europe BV Zero Coupon 20 - 03.03.23	100 000	EUR	100 321	98 079	0,02
PACCAR Financial Europe BV 0.125% 19 - 03.07.22	100 000	EUR	100 544	98 439	0,02
PostNL NV 0.625% 19 - 23.09.26	100 000	EUR	100 061	97 935	0,02
PostNL NV 1.00% 17 - 21.11.24	200 000	EUR	202 384	201 136	0,03
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.375% 20 - 19.05.26	300 000	EUR	300 486	301 275	0,05
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.75% 20 - 19.05.30	360 000	EUR	363 971	365 900	0,06
RELX Finance BV Zero Coupon 20 - 18.03.24	294 000	EUR	285 879	290 046	0,05
RELX Finance BV 0.50% 20 - 03.10.28	221 000	EUR	208 582	216 761	0,04
RELX Finance BV 0.875% 20 - 03.10.32	238 000	EUR	226 002	233 890	0,04
RELX Finance BV 1.00% 17 - 22.03.24	100 000	EUR	101 293	102 258	0,02
RELX Finance BV 1.375% 16 - 05.12.26	200 000	EUR	208 030	210 084	0,04
RELX Finance BV 1.50% 18 - 13.05.27	250 000	EUR	256 799	263 450	0,04
Ren Finance BV 1.75% 16 - 06.01.23	200 000	EUR	208 981	207 868	0,04
Ren Finance BV 1.75% 18 - 18.01.28	100 000	EUR	103 625	106 795	0,02
Ren Finance BV 2.50% 15 - 02.12.25	200 000	EUR	218 028	217 306	0,04
Repsol International Finance BV 0.25% 19 - 08.02.27	300 000	EUR	289 384	286 749	0,05
Repsol International Finance BV 0.50% 17 - 23.05.22	300 000	EUR	298 631	300 984	0,05
Repsol International Finance BV 2.00% 20 - 15.12.25	300 000	EUR	308 260	320 994	0,05
Repsol International Finance BV 2.25% 14 - 12.10.26	100 000	EUR	107 542	109 406	0,02
Repsol International Finance BV 2.625% 20 - 15.04.30	300 000	EUR	321 501	333 636	0,06
Repsol International Finance BV 3.625% 13 - 10.07.21	300 000	EUR	313 727	312 378	0,05
Robert Bosch Investment Nederland BV 2.625% 13 - 24.05.28	300 000	EUR	350 370	354 405	0,06
Roche Finance Europe BV 0.50% 16 - 27.02.23	326 000	EUR	329 713	331 278	0,06
Roche Finance Europe BV 0.875% 15 - 25.02.25	300 000	EUR	312 910	313 011	0,05
Schaeffler Finance BV 3.25% 15 - 15.05.25	259 000	EUR	258 438	256 661	0,04
Schlumberger Finance BV Zero Coupon 19 - 15.10.24	200 000	EUR	193 086	195 456	0,03
Schlumberger Finance BV 0.25% 19 - 15.10.27	250 000	EUR	238 092	236 088	0,04
Schlumberger Finance BV 0.25% 19 - 15.10.27	111 000	EUR	101 564	104 823	0,02
Schlumberger Finance BV 0.50% 19 - 15.10.31	361 000	EUR	339 452	333 250	0,06
Schlumberger Finance BV 1.375% 20 - 28.10.26	260 000	EUR	258 940	265 811	0,05
Schlumberger Finance BV 1.375% 20 - 28.10.26	100 000	EUR	102 947	102 235	0,02
Schlumberger Finance BV 2.00% 20 - 05.06.32	260 000	EUR	261 553	278 096	0,05
Signify NV 2.00% 20 - 05.11.24	310 000	EUR	312 463	313 673	0,05
Signify NV 2.375% 20 - 05.11.27	180 000	EUR	182 593	184 604	0,03
Sika Capital BV 0.875% 19 - 29.04.27	200 000	EUR	206 311	206 318	0,04
Sika Capital BV 1.50% 19 - 29.04.31	200 000	EUR	205 852	214 166	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Sudzucker International Finance BV 1.00% 17 - 28.11.25	300 000	EUR	289 880	288 618	0,05
Telefonica Europe BV 5.875% 03 - 14.02.33	100 000	EUR	153 332	153 866	0,03
Toyota Motor Finance Netherlands BV 0.25% 19 - 01.10.22	200 000	EUR	200 494	200 058	0,03
Toyota Motor Finance Netherlands BV 0.625% 18 - 26.09.23	200 000	EUR	203 871	202 090	0,03
Unilever NV Zero Coupon 17 - 31.07.21	100 000	EUR	100 231	99 959	0,02
Unilever NV 0.375% 17 - 14.02.23	200 000	EUR	202 272	202 652	0,03
Unilever NV 0.50% 15 - 02.03.22	300 000	EUR	302 331	302 901	0,05
Unilever NV 0.50% 16 - 29.04.24	200 000	EUR	203 522	205 090	0,03
Unilever NV 0.50% 18 - 08.12.23	200 000	EUR	201 753	203 966	0,03
Unilever NV 0.50% 18 - 01.06.25	300 000	EUR	302 625	307 857	0,05
Unilever NV 0.875% 17 - 31.07.25	300 000	EUR	309 432	313 545	0,05
Unilever NV 1.00% 15 - 06.03.23	100 000	EUR	103 632	103 359	0,02
Unilever NV 1.00% 17 - 14.02.27	300 000	EUR	316 674	318 756	0,05
Unilever NV 1.125% 16 - 29.04.28	300 000	EUR	315 491	323 709	0,05
Unilever NV 1.125% 18 - 02.12.27	300 000	EUR	318 091	321 678	0,05
Unilever NV 1.25% 20 - 25.03.25	377 000	EUR	393 714	398 662	0,07
Unilever NV 1.375% 17 - 31.07.29	200 000	EUR	215 544	222 094	0,04
Unilever NV 1.375% 18 - 09.04.30	200 000	EUR	219 860	223 700	0,04
Unilever NV 1.625% 18 - 02.12.33	200 000	EUR	218 484	229 594	0,04
Unilever NV 1.75% 20 - 25.03.30	377 000	EUR	408 770	427 884	0,07
Vonovia Finance BV 0.125% 19 - 04.06.23	100 000	EUR	100 124	99 313	0,02
Vonovia Finance BV 0.50% 19 - 14.09.29	100 000	EUR	98 082	96 285	0,02
Vonovia Finance BV 0.50% 19 - 14.09.29	100 000	EUR	97 801	96 285	0,02
Vonovia Finance BV 0.625% 19 - 10.07.27	200 000	EUR	200 022	197 726	0,03
Vonovia Finance BV 0.75% 17 - 25.01.22	200 000	EUR	202 459	201 434	0,03
Vonovia Finance BV 0.75% 18 - 15.01.24	200 000	EUR	201 015	202 634	0,03
Vonovia Finance BV 0.875% 16 - 06.10.22	100 000	EUR	100 528	101 112	0,02
Vonovia Finance BV 0.875% 18 - 07.03.23	200 000	EUR	203 722	203 112	0,03
Vonovia Finance BV 1.125% 17 - 09.08.25	200 000	EUR	199 584	205 924	0,04
Vonovia Finance BV 1.125% 19 - 14.09.34	200 000	EUR	193 595	194 440	0,03
Vonovia Finance BV 1.25% 16 - 12.06.24	400 000	EUR	411 756	415 188	0,07
Vonovia Finance BV 1.50% 15 - 31.03.25	100 000	EUR	104 833	104 972	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 15 - 31.03.25	100 000	EUR	106 086	104 972	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 16 - 06.10.26	100 000	EUR	105 344	104 830	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 14.01.28	200 000	EUR	208 345	210 096	0,04
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 22.03.26	200 000	EUR	202 121	210 446	0,04
Vonovia Finance BV 1.625% 19 - 10.07.39	200 000	EUR	193 389	197 150	0,03
Vonovia Finance BV 1.625% 20 - 04.07.24	300 000	EUR	309 434	312 783	0,05
Vonovia Finance BV 1.75% 17 - 25.01.27	200 000	EUR	208 982	213 212	0,04
Vonovia Finance BV 1.80% 19 - 29.06.25	100 000	EUR	106 341	106 099	0,02
Vonovia Finance BV 1.80% 19 - 29.06.25	100 000	EUR	102 340	106 099	0,02
Vonovia Finance BV 2.125% 14 - 07.09.22	200 000	EUR	205 056	207 246	0,04
Vonovia Finance BV 2.125% 18 - 22.03.30	100 000	EUR	109 011	110 651	0,02
Vonovia Finance BV 2.25% 15 - 15.12.23	100 000	EUR	107 654	106 636	0,02
Vonovia Finance BV 2.25% 20 - 04.07.30	200 000	EUR	217 562	222 890	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Vonovia Finance BV 2.75% 18 - 22.03.38	200 000	EUR	226 437	231 548	0,04
Vonovia Finance BV 3.625% 13 - 10.08.21	150 000	EUR	157 010	156 161	0,03
Vonovia Finance BV FRN 14 - 29.12.49	400 000	EUR	415 169	409 556	0,07
Wolters Kluwer NV 0.75% 20 - 07.03.30	150 000	EUR	148 938	148 752	0,03
Wolters Kluwer NV 1.50% 17 - 22.03.27	200 000	EUR	209 193	211 444	0,04
Wolters Kluwer NV 2.50% 14 - 13.05.24	200 000	EUR	216 221	214 956	0,04
Wolters Kluwer NV 2.875% 13 - 21.03.23	100 000	EUR	106 696	106 681	0,02
WPC Eurobond BV 1.35% 19 - 15.04.28	200 000	EUR	200 841	196 900	0,03
WPC Eurobond BV 2.125% 18 - 15.04.27	200 000	EUR	207 709	207 208	0,04
WPC Eurobond BV 2.25% 17 - 19.07.24	100 000	EUR	107 153	104 288	0,02
WPC Eurobond BV 2.25% 18 - 04.09.26	200 000	EUR	205 743	209 670	0,04
			83 647 152	83 919 026	14,23
Nouvelle-Zélande					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.375% 19 - 17.09.29	200 000	EUR	198 374	196 502	0,03
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.40% 17 - 03.01.22	275 000	EUR	276 727	276 411	0,05
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.625% 16 - 06.01.21	200 000	EUR	201 178	201 170	0,03
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 1.125% 18 - 20.03.25	200 000	EUR	203 805	208 376	0,04
ASB Finance Ltd. 0.50% 17 - 06.10.22	200 000	EUR	201 561	201 376	0,03
ASB Finance Ltd. 0.50% 19 - 24.09.29	200 000	EUR	195 018	199 104	0,03
ASB Finance Ltd. 0.75% 19 - 13.03.24	300 000	EUR	305 536	306 207	0,05
Chorus Ltd. 0.875% 19 - 12.05.26	100 000	EUR	99 988	100 451	0,02
Chorus Ltd. 1.125% 16 - 18.10.23	200 000	EUR	202 084	204 342	0,04
Fonterra Co-operative Group Ltd. 0.75% 16 - 11.08.24	150 000	EUR	154 417	150 280	0,03
Westpac Securities NZ Ltd. 0.30% 19 - 25.06.24	200 000	EUR	201 669	201 210	0,03
			2 240 357	2 245 429	0,38
Norvège					
DNB Bank ASA 0.05% 19 - 14.11.23	530 000	EUR	529 155	529 327	0,09
DNB Bank ASA 0.05% 19 - 14.11.23	200 000	EUR	196 853	199 746	0,04
DNB Bank ASA 0.25% 19 - 04.09.24	250 000	EUR	251 074	251 633	0,04
DNB Bank ASA 0.60% 18 - 25.09.23	300 000	EUR	305 317	305 481	0,05
DNB Bank ASA 1.125% 16 - 03.01.23	400 000	EUR	412 348	412 028	0,07
DNB Bank ASA 18 - 20.03.28	200 000	EUR	197 788	198 542	0,03
DNB Bank ASA FRN 17 - 03.01.27	100 000	EUR	100 738	99 883	0,02
DNB Bank ASA 4.25% 12 - 18.01.22	400 000	EUR	427 763	426 176	0,07
Santander Consumer Bank AS 0.125% 19 - 09.11.24	200 000	EUR	195 563	193 958	0,03
Santander Consumer Bank AS 0.125% 20 - 25.02.25	300 000	EUR	295 145	287 985	0,05
Santander Consumer Bank AS 0.75% 18 - 03.01.23	300 000	EUR	299 453	299 955	0,05
Santander Consumer Bank AS 0.875% 19 - 21.01.22	300 000	EUR	301 569	301 833	0,05
Sparebank 1 Oestlandet 0.25% 19 - 30.09.24	200 000	EUR	200 173	198 870	0,03
Sparebank 1 Oestlandet 0.875% 18 - 13.03.23	100 000	EUR	100 113	101 463	0,02
SpareBank 1 SMN 0.125% 19 - 09.11.26	200 000	EUR	194 262	195 308	0,03
SpareBank 1 SMN 0.50% 17 - 03.09.22	300 000	EUR	300 916	300 660	0,05
SpareBank 1 SMN 0.75% 18 - 07.03.23	200 000	EUR	201 967	202 010	0,04
SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.375% 16 - 02.10.22	300 000	EUR	299 022	300 117	0,05
SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.625% 19 - 25.03.24	200 000	EUR	201 839	201 020	0,04
Sparebanken Vest 0.50% 17 - 29.11.22	100 000	EUR	99 966	100 127	0,02
Storebrand Livsforsikring AS FRN 13 - 04.04.43	110 000	EUR	127 537	121 037	0,02
			5 238 561	5 227 159	0,89

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pologne					
mBank SA 1.058% 18 - 09.05.22	200 000	EUR	196 272	197 532	0,03
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA 0.75% 17 - 25.07.21	100 000	EUR	100 868	99 345	0,02
Santander Bank Polska SA 0.75% 18 - 20.09.21	100 000	EUR	100 309	100 188	0,02
			397 449	397 065	0,07
Portugal					
Galp Gas Natural Distribuicao SA 1.375% 16 - 19.09.23	200 000	EUR	202 095	203 270	0,03
NOS Sgpps SA 1.125% 18 - 05.02.23	100 000	EUR	100 764	100 962	0,02
			302 859	304 232	0,05
Roumanie					
UniCredit Leasing Corp. IFN SA 0.502% 19 - 18.10.22	200 000	EUR	200 312	196 894	0,03
			200 312	196 894	0,03
Singapour					
DBS Group Holdings Ltd. FRN 18 - 04.11.28	300 000	EUR	301 123	303 600	0,05
			301 123	303 600	0,05
Espagne					
Abertis Infraestructuras SA 0.625% 19 - 15.07.25	300 000	EUR	299 220	283 221	0,05
Abertis Infraestructuras SA 1.00% 16 - 27.02.27	200 000	EUR	187 210	185 710	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.125% 19 - 26.03.28	300 000	EUR	291 652	273 741	0,05
Abertis Infraestructuras SA 1.25% 20 - 02.07.28	200 000	EUR	198 549	185 282	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.375% 16 - 20.05.26	500 000	EUR	499 904	479 975	0,08
Abertis Infraestructuras SA 1.50% 19 - 27.06.24	300 000	EUR	304 363	298 464	0,05
Abertis Infraestructuras SA 1.625% 19 - 15.07.29	200 000	EUR	188 615	186 622	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.875% 19 - 26.03.32	200 000	EUR	199 831	182 292	0,03
Abertis Infraestructuras SA 2.25% 20 - 29.03.29	200 000	EUR	198 399	196 398	0,03
Abertis Infraestructuras SA 2.375% 19 - 27.09.27	300 000	EUR	311 581	301 662	0,05
Abertis Infraestructuras SA 2.50% 14 - 27.02.25	200 000	EUR	213 303	206 732	0,04
Abertis Infraestructuras SA 3.00% 19 - 27.03.31	300 000	EUR	326 379	309 828	0,05
Abertis Infraestructuras SA 3.75% 13 - 20.06.23	200 000	EUR	215 985	212 980	0,04
ACS Servicios Comunicaciones y Energia SL 1.875% 18 - 20.04.26	300 000	EUR	305 389	309 996	0,05
Amadeus Capital Markets SAU 1.625% 15 - 17.11.21	100 000	EUR	102 185	100 814	0,02
Amadeus Capital Markets SAU 1.625% 15 - 17.11.21	100 000	EUR	102 137	100 814	0,02
Amadeus IT Group SA 0.875% 18 - 18.09.23	300 000	EUR	303 046	295 545	0,05
Amadeus IT Group SA 1.50% 18 - 18.09.26	200 000	EUR	199 061	200 358	0,03
Amadeus IT Group SA 2.50% 20 - 20.05.24	200 000	EUR	202 395	206 694	0,04
Amadeus IT Group SA 2.875% 20 - 20.05.27	200 000	EUR	207 325	211 182	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 10.02.24	300 000	EUR	296 707	291 546	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 15.11.26	300 000	EUR	299 007	295 998	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.50% 20 - 14.01.27	500 000	EUR	492 934	478 440	0,08
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.625% 17 - 17.01.22	400 000	EUR	404 267	402 776	0,07

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 17 - 09.11.22	300 000	EUR	300 443	301 230	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 17 - 09.11.22	300 000	EUR	301 864	301 230	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 20 - 06.04.25	500 000	EUR	501 109	503 845	0,09
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.00% 19 - 21.06.26	300 000	EUR	295 937	298 329	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 20 - 16.01.30	300 000	EUR	298 575	281 640	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 20 - 16.01.30	100 000	EUR	93 716	93 880	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.125% 19 - 28.02.24	400 000	EUR	400 826	402 132	0,07
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.375% 18 - 14.05.25	300 000	EUR	298 896	305 667	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19 - 22.02.29	100 000	EUR	104 701	101 705	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19 - 22.02.29	200 000	EUR	206 885	203 410	0,03
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.50% 17 - 02.10.27	400 000	EUR	447 693	440 612	0,07
Banco de Sabadell SA FRN 19 - 11.07.25	200 000	EUR	198 527	189 330	0,03
Banco de Sabadell SA 0.875% 17 - 03.05.23	300 000	EUR	295 800	293 598	0,05
Banco de Sabadell SA 0.875% 19 - 22.07.25	300 000	EUR	295 733	286 053	0,05
Banco de Sabadell SA 1.125% 19 - 27.03.25	300 000	EUR	284 821	272 445	0,05
Banco de Sabadell SA 1.625% 18 - 03.07.24	200 000	EUR	201 486	198 424	0,03
Banco de Sabadell SA 1.75% 19 - 05.10.24	400 000	EUR	394 023	379 480	0,06
Banco Santander SA 0.25% 19 - 19.06.24	500 000	EUR	501 244	499 050	0,08
Banco Santander SA 0.30% 19 - 10.04.26	400 000	EUR	399 506	398 620	0,07
Banco Santander SA 0.50% 20 - 02.04.27	300 000	EUR	297 259	287 733	0,05
Banco Santander SA 1.125% 18 - 17.01.25	400 000	EUR	406 982	405 432	0,07
Banco Santander SA 1.375% 15 - 14.12.22	200 000	EUR	205 988	206 246	0,04
Banco Santander SA 1.375% 15 - 14.12.22	400 000	EUR	412 763	412 492	0,07
Banco Santander SA 1.375% 17 - 02.09.22	600 000	EUR	608 420	607 638	0,10
Banco Santander SA 1.375% 20 - 01.05.26	500 000	EUR	499 418	508 690	0,09
Banco Santander SA 2.125% 18 - 02.08.28	500 000	EUR	506 780	505 300	0,09
Banco Santander SA 2.50% 15 - 18.03.25	400 000	EUR	423 337	417 292	0,07
Banco Santander SA 3.125% 17 - 19.01.27	400 000	EUR	443 592	431 416	0,07
Banco Santander SA 3.25% 16 - 04.04.26	600 000	EUR	649 631	647 442	0,11
Bankia SA 0.75% 19 - 07.09.26	400 000	EUR	386 278	386 944	0,07
Bankia SA 0.875% 19 - 25.03.24	300 000	EUR	303 435	298 137	0,05
Bankia SA 1.00% 19 - 25.06.24	100 000	EUR	100 503	96 129	0,02
Bankia SA 1.125% 19 - 11.12.26	200 000	EUR	203 280	186 314	0,03
Bankinter SA 0.625% 20 - 10.06.27	200 000	EUR	199 926	188 866	0,03
Bankinter SA 0.875% 19 - 03.05.24	200 000	EUR	204 118	202 802	0,03
Bankinter SA 0.875% 19 - 07.08.26	300 000	EUR	293 137	291 267	0,05
Bankinter SA FRN 17 - 04.06.27	300 000	EUR	298 049	300 312	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
CaixaBank SA 0.375% 20 - 02.03.25	300 000	EUR	301 590	294 861	0,05
CaixaBank SA 0.625% 19 - 10.01.24	400 000	EUR	384 988	388 824	0,07
CaixaBank SA 0.75% 18 - 18.04.23	300 000	EUR	298 332	301 233	0,05
CaixaBank SA 1.125% 17 - 17.05.24	400 000	EUR	410 037	406 036	0,07
CaixaBank SA 1.125% 17 - 01.12.23	500 000	EUR	501 028	500 925	0,08
CaixaBank SA 1.125% 19 - 27.03.26	400 000	EUR	399 556	406 464	0,07
CaixaBank SA 1.375% 19 - 19.06.26	500 000	EUR	508 053	498 740	0,08
CaixaBank SA 1.75% 18 - 24.10.23	400 000	EUR	402 690	407 196	0,07
CaixaBank SA FRN 18 - 17.04.30	300 000	EUR	302 184	295 203	0,05
CaixaBank SA 2.375% 19 - 02.01.24	300 000	EUR	313 023	311 772	0,05
CaixaBank SA FRN 17 - 14.07.28	400 000	EUR	412 797	405 476	0,07
CaixaBank SA FRN 17 - 15.02.27	400 000	EUR	414 120	408 580	0,07
Enagas Financiaciones SA 0.75% 16 - 27.10.26	200 000	EUR	203 607	205 946	0,03
Enagas Financiaciones SA 1.00% 15 - 25.03.23	200 000	EUR	203 296	204 476	0,03
Enagas Financiaciones SA 1.25% 15 - 02.06.25	200 000	EUR	206 544	210 316	0,04
Enagas Financiaciones SA 1.375% 16 - 05.05.28	300 000	EUR	319 030	324 960	0,06
Enagas Financiaciones SA 2.50% 14 - 04.11.22	200 000	EUR	209 084	208 404	0,04
FCC Aqualia SA 1.413% 17 - 06.08.22	200 000	EUR	200 154	200 362	0,03
FCC Aqualia SA 2.629% 17 - 06.08.27	300 000	EUR	314 584	312 840	0,05
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SA 0.815% 19 - 12.04.23	100 000	EUR	100 635	99 479	0,02
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SA 0.815% 19 - 12.04.23	200 000	EUR	200 349	198 958	0,03
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SA 1.661% 19 - 12.04.26	100 000	EUR	101 216	99 611	0,02
Ferrovial Emisiones SA 0.375% 16 - 14.09.22	200 000	EUR	200 296	199 440	0,03
Ferrovial Emisiones SA 1.375% 17 - 31.03.25	200 000	EUR	207 372	205 010	0,03
Ferrovial Emisiones SA 1.382% 20 - 14.05.26	300 000	EUR	301 045	303 738	0,05
Ferrovial Emisiones SA 2.50% 14 - 15.07.24	100 000	EUR	107 016	107 033	0,02
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.45% 16 - 28.10.24	200 000	EUR	205 438	200 376	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.625% 17 - 28.11.25	200 000	EUR	201 006	200 208	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.00% 18 - 17.04.26	200 000	EUR	211 445	202 260	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.50% 17 - 28.11.29	100 000	EUR	112 457	101 681	0,02
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.728% 15 - 06.05.23	200 000	EUR	208 005	209 848	0,04
Mapfre SA 1.625% 16 - 19.05.26	400 000	EUR	422 053	427 148	0,07
Mapfre SA FRN 18 - 09.07.48	200 000	EUR	221 741	214 510	0,04
Mapfre SA FRN 17 - 31.03.47	200 000	EUR	214 687	216 968	0,04
Red Electrica Corp. SA 0.875% 20 - 14.04.25	200 000	EUR	206 118	207 544	0,04
Red Electrica Financiaciones SAU 0.375% 20 - 24.07.28	300 000	EUR	304 914	302 250	0,05
Red Electrica Financiaciones SAU 1.00% 16 - 21.04.26	100 000	EUR	99 983	105 011	0,02
Red Electrica Financiaciones SAU 1.125% 15 - 24.04.25	300 000	EUR	314 024	315 330	0,05
Red Electrica Financiaciones SAU 1.25% 18 - 13.03.27	200 000	EUR	208 381	213 068	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Red Electrica Financiaciones SAU 3.875% 13 - 25.01.22	100 000	EUR	106 312	105 948	0,02
Santander Consumer Finance SA 0.375% 19 - 27.06.24	300 000	EUR	300 669	296 364	0,05
Santander Consumer Finance SA 0.375% 19 - 27.06.24	100 000	EUR	97 083	98 788	0,02
Santander Consumer Finance SA 0.375% 20 - 17.01.25	300 000	EUR	293 759	295 575	0,05
Santander Consumer Finance SA 0.50% 17 - 10.04.21	300 000	EUR	302 371	301 074	0,05
Santander Consumer Finance SA 0.50% 19 - 14.11.26	300 000	EUR	288 125	294 306	0,05
Santander Consumer Finance SA 0.875% 17 - 24.01.22	400 000	EUR	403 565	402 560	0,07
Santander Consumer Finance SA 0.875% 18 - 30.05.23	100 000	EUR	101 069	100 910	0,02
Santander Consumer Finance SA 1.00% 19 - 27.02.24	300 000	EUR	300 135	303 945	0,05
Santander Consumer Finance SA 1.125% 18 - 10.09.23	300 000	EUR	306 071	305 187	0,05
Telefonica Emisiones SA 0.664% 20 - 02.03.30	400 000	EUR	397 900	388 436	0,07
Telefonica Emisiones SA 0.75% 16 - 13.04.22	400 000	EUR	403 036	404 656	0,07
Telefonica Emisiones SA 1.069% 19 - 02.05.24	100 000	EUR	103 304	102 756	0,02
Telefonica Emisiones SA 1.069% 19 - 02.05.24	300 000	EUR	306 202	308 268	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.201% 20 - 21.08.27	400 000	EUR	408 437	412 872	0,07
Telefonica Emisiones SA 1.447% 18 - 22.01.27	400 000	EUR	416 597	420 368	0,07
Telefonica Emisiones SA 1.46% 16 - 13.04.26	500 000	EUR	516 341	524 915	0,09
Telefonica Emisiones SA 1.477% 15 - 14.09.21	200 000	EUR	202 785	203 402	0,03
Telefonica Emisiones SA 1.495% 18 - 09.11.25	300 000	EUR	312 095	315 291	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.528% 17 - 17.01.25	400 000	EUR	421 249	419 652	0,07
Telefonica Emisiones SA 1.715% 17 - 01.12.28	500 000	EUR	525 738	537 100	0,09
Telefonica Emisiones SA 1.788% 19 - 03.12.29	400 000	EUR	423 378	429 280	0,07
Telefonica Emisiones SA 1.807% 20 - 21.05.32	300 000	EUR	312 606	315 813	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.93% 16 - 17.10.31	300 000	EUR	304 088	324 099	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.957% 19 - 07.01.39	200 000	EUR	202 395	210 282	0,04
Telefonica Emisiones SA 2.242% 14 - 27.05.22	300 000	EUR	310 554	311 994	0,05
Telefonica Emisiones SA 2.318% 17 - 17.10.28	300 000	EUR	331 581	338 166	0,06
Telefonica Emisiones SA 2.932% 14 - 17.10.29	100 000	EUR	108 114	118 051	0,02
Telefonica Emisiones SA 2.932% 14 - 17.10.29	100 000	EUR	112 316	118 051	0,02
Telefonica Emisiones SA 2.932% 14 - 17.10.29	100 000	EUR	115 519	118 051	0,02
Telefonica Emisiones SA 3.987% 13 - 23.01.23	500 000	EUR	544 414	548 965	0,09
			38 344 811	38 125 412	6,46
Suède					
Akelius Residential Property AB 1.125% 17 - 14.03.24	200 000	EUR	197 116	198 904	0,03
Akelius Residential Property AB 1.50% 16 - 23.01.22	350 000	EUR	356 921	354 585	0,06
Akelius Residential Property AB 1.75% 17 - 02.07.25	100 000	EUR	101 894	101 110	0,02
Atlas Copco AB 0.625% 16 - 30.08.26	200 000	EUR	203 396	204 944	0,03
Atlas Copco AB 2.50% 13 - 28.02.23	100 000	EUR	105 388	106 446	0,02
Castellum AB 0.75% 19 - 09.04.26	200 000	EUR	192 978	187 080	0,03
Castellum AB 2.125% 18 - 20.11.23	200 000	EUR	204 759	205 560	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Suède (suite)					
Essity AB 0.50% 20 - 02.03.30	100 000	EUR	99 703	96 963	0,02
Essity AB 0.625% 17 - 28.03.22	100 000	EUR	101 004	100 720	0,02
Essity AB 1.125% 15 - 03.05.25	100 000	EUR	103 096	103 471	0,02
Essity AB 1.125% 17 - 27.03.24	400 000	EUR	407 165	411 712	0,07
Essity AB 1.625% 17 - 30.03.27	200 000	EUR	205 790	213 718	0,04
Essity AB 2.50% 13 - 06.09.23	100 000	EUR	106 446	106 413	0,02
Fastighets AB Balder 1.125% 17 - 14.03.22	200 000	EUR	200 701	199 750	0,03
Fastighets AB Balder 1.125% 19 - 29.01.27	200 000	EUR	192 446	187 940	0,03
Fastighets AB Balder 1.25% 20 - 28.01.28	100 000	EUR	100 330	93 270	0,02
Fastighets AB Balder 1.875% 17 - 14.03.25	150 000	EUR	150 104	151 124	0,03
Fastighets AB Balder 1.875% 17 - 23.01.26	200 000	EUR	200 257	199 342	0,03
Investor AB 1.50% 18 - 09.12.30	300 000	EUR	316 791	322 962	0,05
Investor AB 1.50% 19 - 20.06.39	100 000	EUR	102 976	105 733	0,02
Investor AB 4.50% 11 - 05.12.23	315 000	EUR	353 742	353 565	0,06
Investor AB 4.875% 09 - 18.11.21	200 000	EUR	212 567	213 384	0,04
Lansforsakringar Bank AB 0.125% 20 - 19.02.25	266 000	EUR	263 319	261 132	0,04
Lansforsakringar Bank AB 0.50% 17 - 19.09.22	300 000	EUR	300 197	301 071	0,05
Lansforsakringar Bank AB 0.875% 18 - 25.09.23	100 000	EUR	102 844	101 540	0,02
Molnlycke Holding AB 0.875% 19 - 09.05.29	150 000	EUR	151 144	142 200	0,02
Molnlycke Holding AB 1.75% 15 - 28.02.24	200 000	EUR	207 477	207 152	0,04
Molnlycke Holding AB 1.875% 17 - 28.02.25	242 000	EUR	251 528	251 273	0,04
ORLEN Capital AB 2.50% 14 - 30.06.21	100 000	EUR	100 614	101 256	0,02
ORLEN Capital AB 2.50% 16 - 06.07.23	300 000	EUR	316 793	310 572	0,05
Sagax AB 1.125% 20 - 30.01.27	100 000	EUR	100 459	92 330	0,02
Sagax AB 2.00% 18 - 17.01.24	100 000	EUR	100 653	99 888	0,02
Sagax AB 2.25% 19 - 13.03.25	200 000	EUR	202 870	200 346	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.05% 19 - 07.01.24	200 000	EUR	199 966	199 524	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.05% 19 - 07.01.24	200 000	EUR	199 191	199 524	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.25% 20 - 19.05.23	510 000	EUR	511 694	513 203	0,09
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.30% 17 - 17.02.22	200 000	EUR	200 950	200 968	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.375% 20 - 02.11.27	400 000	EUR	398 855	395 244	0,07
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.50% 18 - 13.03.23	207 000	EUR	208 569	209 681	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.625% 19 - 11.12.29	200 000	EUR	199 116	198 914	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.75% 16 - 24.08.21	300 000	EUR	301 903	302 661	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 16 - 31.10.28	400 000	EUR	400 623	401 692	0,07
SKF AB 0.875% 19 - 15.11.29	100 000	EUR	101 898	99 040	0,02
SKF AB 1.25% 18 - 17.09.25	100 000	EUR	99 588	103 523	0,02
Svenska Handelsbanken AB 0.05% 19 - 09.03.26	200 000	EUR	199 617	195 360	0,03
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 19 - 18.06.24	200 000	EUR	200 602	200 808	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Suède (suite)					
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 19 - 18.06.24	200 000	EUR	201 339	200 808	0,03
Svenska Handelsbanken AB 0.25% 17 - 28.02.22	400 000	EUR	400 933	401 880	0,07
Svenska Handelsbanken AB 0.375% 18 - 07.03.23	200 000	EUR	202 120	202 434	0,03
Svenska Handelsbanken AB 0.50% 18 - 21.03.23	300 000	EUR	301 563	304 350	0,05
Svenska Handelsbanken AB 0.50% 20 - 18.02.30	431 000	EUR	421 231	422 789	0,07
Svenska Handelsbanken AB 1.00% 20 - 15.04.25	450 000	EUR	465 719	468 851	0,08
Svenska Handelsbanken AB 1.125% 15 - 14.12.22	450 000	EUR	460 920	462 794	0,08
Svenska Handelsbanken AB FRN 18 - 03.02.28	300 000	EUR	301 038	303 480	0,05
Svenska Handelsbanken AB FRN 18 - 03.05.29	200 000	EUR	207 506	205 806	0,04
Svenska Handelsbanken AB 2.625% 12 - 23.08.22	200 000	EUR	210 762	211 196	0,04
Svenska Handelsbanken AB 4.375% 11 - 20.10.21	500 000	EUR	529 266	529 215	0,09
Swedbank AB 0.25% 17 - 11.07.22	200 000	EUR	200 258	200 418	0,03
Swedbank AB 0.25% 19 - 10.09.24	200 000	EUR	194 683	197 522	0,03
Swedbank AB 0.30% 17 - 09.06.22	300 000	EUR	301 336	300 669	0,05
Swedbank AB 0.40% 18 - 29.08.23	200 000	EUR	201 828	201 414	0,03
Swedbank AB 0.75% 20 - 05.05.25	366 000	EUR	369 273	374 176	0,06
Swedbank AB 1.00% 15 - 06.01.22	300 000	EUR	305 755	304 989	0,05
Swedbank AB FRN 17 - 22.11.27	150 000	EUR	146 261	148 152	0,03
Swedbank AB FRN 18 - 18.09.28	300 000	EUR	296 932	299 838	0,05
Tele2 AB 1.125% 18 - 15.05.24	200 000	EUR	203 701	205 894	0,04
Tele2 AB 2.125% 18 - 15.05.28	200 000	EUR	216 463	217 542	0,04
Telia Co. AB FRN 20 - 05.11.81	166 000	EUR	163 688	156 510	0,03
Telia Co. AB 1.625% 15 - 23.02.35	200 000	EUR	201 956	205 206	0,03
Telia Co. AB 2.125% 19 - 20.02.34	200 000	EUR	214 333	218 694	0,04
Telia Co. AB 3.00% 12 - 09.07.27	200 000	EUR	230 914	233 392	0,04
Telia Co. AB FRN 17 - 04.04.78	400 000	EUR	408 920	407 416	0,07
Telia Co. AB 3.50% 13 - 09.05.33	100 000	EUR	122 242	126 066	0,02
Telia Co. AB 3.625% 12 - 14.02.24	330 000	EUR	367 825	369 537	0,06
Telia Co. AB 3.875% 10 - 10.01.25	250 000	EUR	292 198	293 003	0,05
Telia Co. AB 4.00% 11 - 22.03.22	300 000	EUR	319 230	318 786	0,05
Volvo Treasury AB Zero Coupon 20 - 02.11.23	200 000	EUR	197 276	195 506	0,03
Volvo Treasury AB 0.10% 19 - 24.05.22	100 000	EUR	100 064	98 881	0,02
Volvo Treasury AB 1.625% 20 - 26.05.25	200 000	EUR	202 226	205 526	0,03
Volvo Treasury AB FRN 14 - 03.10.78	200 000	EUR	214 184	213 826	0,04
			18 709 983	18 714 164	3,17
Suisse					
Credit Suisse AG 0.45% 20 - 19.05.25	200 000	EUR	202 191	201 726	0,03
Credit Suisse AG 1.00% 16 - 06.07.23	419 000	EUR	428 678	430 208	0,07
Credit Suisse AG 1.375% 14 - 31.01.22	650 000	EUR	663 161	663 689	0,11
Credit Suisse AG 1.50% 16 - 04.10.26	500 000	EUR	529 438	539 710	0,09
Credit Suisse Group AG 0.65% 19 - 09.10.29	400 000	EUR	394 864	388 096	0,07
Credit Suisse Group AG FRN 20 - 14.01.28	510 000	EUR	494 101	495 674	0,08
Credit Suisse Group AG FRN 19 - 24.06.27	500 000	EUR	509 457	499 400	0,09
Credit Suisse Group AG FRN 17 - 17.07.25	600 000	EUR	602 943	611 976	0,10
Credit Suisse Group AG FRN 20 - 04.02.26	631 000	EUR	685 435	699 022	0,12
UBS AG 0.125% 17 - 11.05.21	400 000	EUR	400 585	400 696	0,07
UBS AG 0.25% 18 - 01.10.22	200 000	EUR	201 056	200 608	0,03
UBS AG 0.625% 18 - 23.01.23	600 000	EUR	607 344	607 860	0,10

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Suisse (suite)					
UBS AG 0.75% 20 - 21.04.23	731 000	EUR	738 483	742 521	0,13
UBS AG 1.25% 14 - 09.03.21	450 000	EUR	457 121	457 033	0,08
UBS Group AG FRN 20 - 29.01.26	612 000	EUR	606 499	600 929	0,10
UBS Group AG 1.25% 16 - 09.01.26	600 000	EUR	614 885	622 902	0,11
UBS Group AG FRN 18 - 17.04.25	600 000	EUR	604 948	615 318	0,10
UBS Group AG 1.50% 16 - 30.11.24	400 000	EUR	414 908	413 124	0,07
UBS Group AG 1.75% 15 - 16.11.22	400 000	EUR	416 114	413 392	0,07
UBS Group AG 2.125% 16 - 03.04.24	200 000	EUR	211 171	212 272	0,04
			9 783 382	9 816 156	1,66
Royaume-Uni					
Anglo American Capital PLC 1.625% 17 - 18.09.25	200 000	EUR	203 920	200 402	0,03
Anglo American Capital PLC 1.625% 19 - 03.11.26	200 000	EUR	198 806	198 558	0,03
Anglo American Capital PLC 3.25% 14 - 04.03.23	300 000	EUR	322 494	316 470	0,05
Anglo American Capital PLC 3.50% 12 - 28.03.22	200 000	EUR	209 471	208 798	0,04
AstraZeneca PLC 0.75% 16 - 05.12.24	300 000	EUR	304 037	306 975	0,05
AstraZeneca PLC 0.875% 14 - 24.11.21	200 000	EUR	202 643	202 382	0,03
AstraZeneca PLC 1.25% 16 - 05.12.28	300 000	EUR	312 647	321 537	0,05
Aviva PLC 0.625% 16 - 27.10.23	200 000	EUR	203 472	202 324	0,03
Aviva PLC 1.875% 18 - 13.11.27	200 000	EUR	208 266	216 446	0,04
Aviva PLC FRN 15 - 12.04.45	300 000	EUR	318 392	318 930	0,05
Aviva PLC FRN 14 - 07.03.44	250 000	EUR	275 171	266 990	0,05
Aviva PLC FRN 13 - 07.05.43	250 000	EUR	289 337	282 502	0,05
Barclays Bank PLC 2.25% 14 - 06.10.24	100 000	EUR	106 102	109 033	0,02
Barclays Bank PLC 6.625% 11 - 30.03.22	350 000	EUR	383 554	381 601	0,06
Barclays PLC FRN 17 - 14.11.23	200 000	EUR	201 135	199 082	0,03
Barclays PLC FRN 19 - 06.09.25	300 000	EUR	297 252	293 556	0,05
Barclays PLC FRN 18 - 24.01.26	300 000	EUR	293 605	302 160	0,05
Barclays PLC 1.50% 14 - 04.01.22	400 000	EUR	406 370	405 300	0,07
Barclays PLC 1.50% 18 - 09.03.23	200 000	EUR	203 412	204 578	0,03
Barclays PLC 1.875% 16 - 12.08.23	400 000	EUR	412 599	413 336	0,07
Barclays PLC FRN 17 - 02.07.28	600 000	EUR	599 809	588 726	0,10
Barclays PLC FRN 20 - 04.02.25	753 000	EUR	774 002	809 016	0,14
Brambles Finance PLC 1.50% 17 - 10.04.27	200 000	EUR	207 406	202 424	0,03
British Telecommunications PLC 0.50% 17 - 23.06.22	200 000	EUR	200 465	200 874	0,03
British Telecommunications PLC 0.50% 19 - 09.12.25	200 000	EUR	200 469	198 412	0,03
British Telecommunications PLC 0.875% 18 - 26.09.23	200 000	EUR	203 646	202 628	0,03
British Telecommunications PLC 1.00% 17 - 23.06.24	300 000	EUR	303 180	305 745	0,05
British Telecommunications PLC 1.00% 17 - 21.11.24	430 000	EUR	432 724	436 403	0,07
British Telecommunications PLC 1.125% 16 - 03.10.23	400 000	EUR	407 795	407 908	0,07
British Telecommunications PLC 1.125% 19 - 09.12.29	100 000	EUR	99 444	100 381	0,02
British Telecommunications PLC 1.125% 19 - 09.12.29	100 000	EUR	101 032	100 381	0,02
British Telecommunications PLC 1.50% 17 - 23.06.27	400 000	EUR	406 991	416 300	0,07
British Telecommunications PLC 1.75% 16 - 03.10.26	100 000	EUR	104 273	105 727	0,02
British Telecommunications PLC 1.75% 16 - 03.10.26	400 000	EUR	420 273	422 908	0,07

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
British Telecommunications PLC 2.125% 18 - 26.09.28	200 000	EUR	210 548	217 702	0,04
Coca-Cola European Partners PLC 0.70% 19 - 09.12.31	100 000	EUR	100 799	97 218	0,02
Coca-Cola European Partners PLC 0.70% 19 - 09.12.31	100 000	EUR	99 395	97 218	0,02
Coca-Cola European Partners PLC 0.75% 16 - 24.02.22	350 000	EUR	353 991	353 024	0,06
Coca-Cola European Partners PLC 1.125% 16 - 26.05.24	374 000	EUR	386 518	386 054	0,07
Coca-Cola European Partners PLC 1.125% 19 - 04.12.29	100 000	EUR	104 847	103 004	0,02
Coca-Cola European Partners PLC 1.50% 18 - 11.08.27	100 000	EUR	103 249	106 825	0,02
Coca-Cola European Partners PLC 1.75% 16 - 26.05.28	200 000	EUR	208 455	216 808	0,04
Coca-Cola European Partners PLC 1.75% 20 - 27.03.26	266 000	EUR	275 734	282 364	0,05
Coca-Cola European Partners PLC 1.875% 15 - 18.03.30	200 000	EUR	214 727	219 022	0,04
Coca-Cola European Partners PLC 2.375% 13 - 05.07.25	100 000	EUR	107 496	109 477	0,02
Compass Group PLC 1.875% 14 - 27.01.23	300 000	EUR	310 354	310 428	0,05
Experian Finance PLC 1.375% 17 - 25.06.26	200 000	EUR	205 463	205 160	0,03
GlaxoSmithKline Capital PLC Zero Coupon 19 - 23.09.21	200 000	EUR	200 591	199 902	0,03
GlaxoSmithKline Capital PLC Zero Coupon 19 - 23.09.23	300 000	EUR	299 453	298 944	0,05
GlaxoSmithKline Capital PLC 0.125% 20 - 05.12.23	230 000	EUR	229 476	230 106	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.00% 17 - 09.12.26	200 000	EUR	205 242	209 720	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.25% 18 - 21.05.26	400 000	EUR	418 407	423 704	0,07
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 14 - 12.02.24	200 000	EUR	208 685	210 844	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 17 - 09.12.29	200 000	EUR	214 144	218 414	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.75% 18 - 21.05.30	300 000	EUR	329 446	336 450	0,06
GlaxoSmithKline Capital PLC 4.00% 05 - 16.06.25	300 000	EUR	354 765	356 916	0,06
Hammerson PLC 1.75% 16 - 15.03.23	200 000	EUR	189 429	170 040	0,03
Hammerson PLC 2.00% 14 - 07.01.22	200 000	EUR	204 309	181 004	0,03
HBOS PLC FRN 05 - 18.03.30	200 000	EUR	217 980	216 514	0,04
Hitachi Capital UK PLC 0.125% 19 - 29.11.22	100 000	EUR	100 068	97 496	0,02
HSBC Holdings PLC 0.875% 16 - 09.06.24	700 000	EUR	719 413	713 678	0,12
HSBC Holdings PLC 1.50% 16 - 15.03.22	800 000	EUR	818 349	817 728	0,14
HSBC Holdings PLC FRN 18 - 12.04.24	400 000	EUR	418 824	414 344	0,07
HSBC Holdings PLC 2.50% 16 - 15.03.27	400 000	EUR	458 498	455 416	0,08
HSBC Holdings PLC 3.00% 15 - 30.06.25	550 000	EUR	603 838	607 574	0,10
HSBC Holdings PLC 3.125% 16 - 06.07.28	400 000	EUR	454 635	466 148	0,08
Informa PLC 1.25% 19 - 22.04.28	200 000	EUR	187 783	182 030	0,03
Informa PLC 1.50% 18 - 07.05.23	250 000	EUR	257 370	245 695	0,04
Intermediate Capital Group PLC 1.625% 20 - 17.02.27	166 000	EUR	164 858	150 004	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 0.25% 19 - 10.04.22	400 000	EUR	397 737	397 048	0,07
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 0.375% 20 - 28.01.25	361 000	EUR	360 853	355 610	0,06
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 2.375% 20 - 04.09.26	366 000	EUR	387 145	393 816	0,07
Lloyds Bank PLC 1.00% 14 - 19.11.21	200 000	EUR	203 007	203 114	0,03
Lloyds Bank PLC 1.25% 15 - 13.01.25	300 000	EUR	310 413	318 510	0,05
Lloyds Bank PLC 1.375% 15 - 09.08.22	200 000	EUR	202 938	205 958	0,03
Lloyds Banking Group PLC FRN 19 - 11.12.25	400 000	EUR	389 691	391 084	0,07
Lloyds Banking Group PLC FRN 18 - 15.01.24	400 000	EUR	397 323	397 680	0,07
Lloyds Banking Group PLC 0.75% 16 - 11.09.21	200 000	EUR	200 271	200 802	0,03
Lloyds Banking Group PLC 1.00% 16 - 11.09.23	300 000	EUR	299 780	302 973	0,05
Lloyds Banking Group PLC 1.50% 17 - 09.12.27	300 000	EUR	298 205	315 309	0,05
Lloyds Banking Group PLC FRN 18 - 09.07.28	200 000	EUR	196 155	199 284	0,03
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 04.01.26	615 000	EUR	649 086	681 894	0,12
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 18.03.30	100 000	EUR	104 412	108 205	0,02
London Stock Exchange Group PLC 0.875% 17 - 19.09.24	200 000	EUR	203 230	205 012	0,03
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 17 - 19.09.29	100 000	EUR	107 007	108 317	0,02
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 18 - 12.06.27	300 000	EUR	319 815	324 993	0,06
Motability Operations Group PLC 0.375% 19 - 01.03.26	250 000	EUR	250 227	249 087	0,04
Motability Operations Group PLC 0.875% 17 - 14.03.25	200 000	EUR	200 615	205 582	0,03
Motability Operations Group PLC 1.625% 15 - 06.09.23	100 000	EUR	104 639	104 666	0,02
National Grid Electricity Transmission PLC 0.19% 20 - 20.01.25	137 000	EUR	138 369	137 289	0,02
National Grid Electricity Transmission PLC 0.19% 20 - 20.01.25	163 000	EUR	163 556	163 344	0,03
Nationwide Building Society 0.625% 17 - 19.04.23	300 000	EUR	304 844	304 353	0,05
Nationwide Building Society 1.125% 15 - 06.03.22	150 000	EUR	153 290	152 921	0,03
Nationwide Building Society 1.25% 15 - 03.03.25	350 000	EUR	363 661	370 076	0,06
Nationwide Building Society FRN 18 - 03.08.26	298 000	EUR	308 911	308 934	0,05
Nationwide Building Society FRN 17 - 25.07.29	400 000	EUR	404 281	400 228	0,07
NatWest Markets PLC 0.625% 18 - 03.02.22	500 000	EUR	498 276	498 035	0,08
NatWest Markets PLC 1.00% 19 - 28.05.24	446 000	EUR	441 366	444 194	0,08
NatWest Markets PLC 1.125% 18 - 14.06.23	100 000	EUR	98 624	100 489	0,02
NatWest Markets PLC 2.75% 20 - 04.02.25	527 000	EUR	539 795	564 723	0,10
NGG Finance PLC FRN 19 - 12.05.79	200 000	EUR	201 850	196 500	0,03
NGG Finance PLC FRN 19 - 09.05.82	320 000	EUR	318 423	313 776	0,05
Omnicom Finance Holdings PLC 0.80% 19 - 07.08.27	200 000	EUR	196 516	193 662	0,03
Omnicom Finance Holdings PLC 1.40% 19 - 07.08.31	200 000	EUR	200 685	198 106	0,03
OTE PLC 0.875% 19 - 24.09.26	250 000	EUR	244 184	245 260	0,04
Pearson Funding PLC 1.375% 15 - 05.06.25	100 000	EUR	101 900	100 184	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Phoenix Group Holdings PLC 4.375% 18 - 24.01.29	200 000	EUR	210 219	212 580	0,04
Rentokil Initial PLC 0.875% 19 - 30.05.26	200 000	EUR	197 370	198 870	0,03
Rentokil Initial PLC 0.95% 17 - 22.11.24	100 000	EUR	102 997	100 519	0,02
Rentokil Initial PLC 3.25% 13 - 10.07.21	100 000	EUR	103 469	102 359	0,02
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 19 - 15.11.25	200 000	EUR	199 526	195 938	0,03
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 18 - 03.02.26	600 000	EUR	601 898	614 472	0,10
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 17 - 03.08.23	575 000	EUR	589 201	585 114	0,10
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 18 - 03.04.25	300 000	EUR	306 970	309 198	0,05
Royal Bank of Scotland Group PLC 2.50% 16 - 22.03.23	500 000	EUR	523 922	520 390	0,09
Royal Mail PLC 1.25% 19 - 10.08.26	200 000	EUR	200 930	191 972	0,03
Royal Mail PLC 2.375% 14 - 29.07.24	200 000	EUR	208 421	208 832	0,04
Santander UK Group Holdings PLC FRN 20 - 28.02.25	248 000	EUR	247 211	240 870	0,04
Santander UK Group Holdings PLC 1.125% 16 - 09.08.23	400 000	EUR	400 280	402 372	0,07
Santander UK PLC 1.125% 15 - 14.01.22	100 000	EUR	101 839	101 447	0,02
Santander UK PLC 1.125% 15 - 03.10.25	200 000	EUR	204 524	208 770	0,04
Smiths Group PLC 1.25% 15 - 28.04.23	200 000	EUR	201 777	200 092	0,03
Smiths Group PLC 2.00% 17 - 23.02.27	200 000	EUR	204 782	205 100	0,03
SSE PLC 0.875% 17 - 09.06.25	200 000	EUR	200 936	202 638	0,03
SSE PLC 1.25% 20 - 16.04.25	259 000	EUR	265 892	267 218	0,05
SSE PLC 1.375% 18 - 09.04.27	200 000	EUR	207 513	208 972	0,04
SSE PLC 1.75% 15 - 09.08.23	100 000	EUR	103 645	104 434	0,02
SSE PLC 1.75% 15 - 09.08.23	200 000	EUR	207 496	208 868	0,04
SSE PLC 1.75% 20 - 16.04.30	233 000	EUR	245 128	243 946	0,04
SSE PLC 2.375% 13 - 02.10.22	100 000	EUR	104 028	103 244	0,02
SSE PLC FRN 20 - 31.12.99	200 000	EUR	200 000	201 014	0,03
Standard Chartered PLC FRN 17 - 10.03.23	200 000	EUR	199 328	199 748	0,03
Standard Chartered PLC FRN 20 - 27.01.28	206 000	EUR	207 385	203 207	0,03
Standard Chartered PLC FRN 19 - 07.02.27	200 000	EUR	194 070	198 566	0,03
Standard Chartered PLC 1.625% 14 - 13.06.21	400 000	EUR	405 108	405 392	0,07
Standard Chartered PLC FRN 17 - 10.03.27	200 000	EUR	209 763	207 666	0,04
Standard Chartered PLC 3.125% 14 - 19.11.24	200 000	EUR	214 501	218 116	0,04
Standard Chartered PLC 3.625% 12 - 23.11.22	193 000	EUR	206 939	206 827	0,04
Swiss Re Finance UK PLC 1.375% 16 - 27.05.23	230 000	EUR	237 134	237 211	0,04
Trinity Acquisition PLC 2.125% 16 - 26.05.22	300 000	EUR	305 173	303 924	0,05
Unilever PLC 1.50% 19 - 06.11.39	200 000	EUR	214 273	226 522	0,04
Vodafone Group PLC 0.375% 17 - 22.11.21	500 000	EUR	501 962	501 895	0,09
Vodafone Group PLC 0.50% 16 - 30.01.24	300 000	EUR	299 486	302 232	0,05
Vodafone Group PLC 0.90% 19 - 24.11.26	300 000	EUR	302 672	305 763	0,05
Vodafone Group PLC 1.125% 17 - 20.11.25	400 000	EUR	411 724	414 260	0,07
Vodafone Group PLC 1.25% 16 - 25.08.21	400 000	EUR	406 034	405 344	0,07
Vodafone Group PLC 1.50% 17 - 24.07.27	200 000	EUR	207 720	211 750	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Vodafone Group PLC 1.60% 16 - 29.07.31	400 000	EUR	412 834	424 972	0,07
Vodafone Group PLC 1.625% 19 - 24.11.30	360 000	EUR	371 717	382 475	0,06
Vodafone Group PLC 1.75% 16 - 25.08.23	500 000	EUR	522 711	523 310	0,09
Vodafone Group PLC 1.875% 14 - 09.11.25	300 000	EUR	318 226	321 093	0,05
Vodafone Group PLC 1.875% 17 - 20.11.29	305 000	EUR	324 999	335 811	0,06
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	100 000	EUR	109 636	109 979	0,02
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	580 000	EUR	629 303	637 878	0,11
Vodafone Group PLC 2.50% 19 - 24.05.39	320 000	EUR	340 069	354 051	0,06
Vodafone Group PLC 2.875% 17 - 20.11.37	200 000	EUR	223 633	232 084	0,04
Vodafone Group PLC 5.375% 07 - 06.06.22	166 000	EUR	184 038	182 686	0,03
Wellcome Trust Ltd. 1.125% 15 - 21.01.27	100 000	EUR	106 316	103 133	0,02
WPP Finance 2013 3.00% 13 - 20.11.23	250 000	EUR	270 736	266 182	0,05
WPP Finance 2016 1.375% 18 - 20.03.25	200 000	EUR	202 693	198 640	0,03
Yorkshire Building Society 0.875% 18 - 20.03.23	100 000	EUR	100 828	100 182	0,02
Yorkshire Building Society 1.25% 15 - 17.03.22	300 000	EUR	304 078	302 991	0,05
			45 097 476	45 279 905	7,68
États-Unis					
3M Co. 0.375% 16 - 15.02.22	255 000	EUR	256 941	256 553	0,04
3M Co. 0.95% 15 - 15.05.23	200 000	EUR	205 081	205 888	0,03
3M Co. 1.50% 14 - 11.09.26	100 000	EUR	103 088	108 781	0,02
3M Co. 1.50% 14 - 11.09.26	100 000	EUR	108 403	108 781	0,02
3M Co. 1.50% 14 - 11.09.26	100 000	EUR	107 989	108 781	0,02
3M Co. 1.50% 16 - 06.02.31	200 000	EUR	217 636	222 216	0,04
3M Co. 1.75% 15 - 15.05.30	100 000	EUR	115 397	112 994	0,02
3M Co. 1.75% 15 - 15.05.30	100 000	EUR	109 252	112 994	0,02
3M Co. 1.875% 13 - 15.11.21	100 000	EUR	102 868	102 636	0,02
AbbVie Inc. 0.75% 19 - 18.11.27	300 000	EUR	297 960	300 111	0,05
AbbVie Inc. 1.25% 19 - 18.11.31	300 000	EUR	303 052	309 165	0,05
AbbVie Inc. 1.375% 16 - 17.05.24	600 000	EUR	620 387	618 504	0,10
AbbVie Inc. 2.125% 16 - 17.11.28	200 000	EUR	210 708	221 534	0,04
Air Products & Chemicals Inc. 0.50% 20 - 05.05.28	150 000	EUR	149 264	150 861	0,03
Air Products & Chemicals Inc. 0.80% 20 - 05.05.32	233 000	EUR	235 627	234 582	0,04
Air Products & Chemicals Inc. 1.00% 15 - 02.12.25	200 000	EUR	207 258	207 544	0,04
American Express Credit Corp. 0.625% 16 - 22.11.21	335 000	EUR	338 013	337 027	0,06
American Honda Finance Corp. 0.35% 19 - 26.08.22	400 000	EUR	400 106	398 600	0,07
American Honda Finance Corp. 0.55% 18 - 17.03.23	300 000	EUR	302 259	300 162	0,05
American Honda Finance Corp. 0.75% 17 - 17.01.24	100 000	EUR	101 482	100 730	0,02
American Honda Finance Corp. 1.375% 15 - 11.10.22	200 000	EUR	206 861	204 004	0,03
American Honda Finance Corp. 1.60% 20 - 20.04.22	233 000	EUR	235 113	237 737	0,04
American Honda Finance Corp. 1.95% 20 - 18.10.24	400 000	EUR	414 894	422 036	0,07
American Tower Corp. 1.375% 17 - 04.04.25	200 000	EUR	205 664	206 174	0,03
American Tower Corp. 1.95% 18 - 22.05.26	200 000	EUR	208 598	212 468	0,04
Amgen Inc. 1.25% 16 - 25.02.22	400 000	EUR	406 259	406 340	0,07
Amgen Inc. 2.00% 16 - 25.02.26	250 000	EUR	269 156	272 242	0,05
Apple Inc. 0.50% 19 - 15.11.25	459 000	EUR	459 144	458 619	0,08
Apple Inc. 0.50% 19 - 15.11.31	350 000	EUR	350 003	357 409	0,06
Apple Inc. 0.875% 17 - 24.05.25	400 000	EUR	412 710	418 420	0,07
Apple Inc. 1.00% 14 - 11.10.22	500 000	EUR	512 683	513 600	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Apple Inc. 1.375% 15 - 17.01.24	100 000	EUR	104 838	105 403	0,02
Apple Inc. 1.375% 15 - 17.01.24	200 000	EUR	209 360	210 806	0,04
Apple Inc. 1.375% 17 - 24.05.29	400 000	EUR	419 111	440 136	0,07
Apple Inc. 1.625% 14 - 11.10.26	500 000	EUR	539 598	549 125	0,09
Apple Inc. 2.00% 15 - 17.09.27	400 000	EUR	449 955	453 976	0,08
Becton Dickinson and Co. 1.00% 16 - 15.12.22	200 000	EUR	202 679	201 010	0,03
Becton Dickinson and Co. 1.90% 16 - 15.12.26	100 000	EUR	105 707	103 653	0,02
BlackRock Inc. 1.25% 15 - 05.06.25	200 000	EUR	206 942	211 308	0,04
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 1.00% 16 - 10.05.26	265 000	EUR	267 726	269 884	0,05
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 1.50% 19 - 04.10.29	165 000	EUR	177 756	176 616	0,03
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 2.00% 15 - 19.05.25	200 000	EUR	211 636	212 042	0,04
BMW US Capital LLC 0.625% 15 - 20.04.22	350 000	EUR	351 526	353 171	0,06
BMW US Capital LLC 1.00% 15 - 20.04.27	200 000	EUR	195 673	205 846	0,03
BMW US Capital LLC 1.125% 15 - 18.09.21	350 000	EUR	354 945	354 588	0,06
Booking Holdings Inc. 0.80% 17 - 03.10.22	300 000	EUR	303 002	301 038	0,05
Booking Holdings Inc. 1.80% 15 - 03.03.27	400 000	EUR	415 588	414 824	0,07
Booking Holdings Inc. 2.15% 15 - 25.11.22	200 000	EUR	208 535	206 422	0,03
Booking Holdings Inc. 2.375% 14 - 23.09.24	300 000	EUR	317 802	318 900	0,05
BorgWarner Inc. 1.80% 15 - 11.07.22	100 000	EUR	102 838	101 547	0,02
Bristol-Myers Squibb Co. 1.00% 15 - 15.05.25	200 000	EUR	207 055	210 284	0,04
Bristol-Myers Squibb Co. 1.75% 15 - 15.05.35	200 000	EUR	228 791	227 332	0,04
Cargill Inc. 2.50% 14 - 15.02.23	200 000	EUR	213 820	211 996	0,04
Celanese US Holdings LLC 1.125% 16 - 26.09.23	300 000	EUR	301 531	296 286	0,05
Celanese US Holdings LLC 1.25% 17 - 02.11.25	100 000	EUR	102 425	97 938	0,02
Celanese US Holdings LLC 2.125% 18 - 03.01.27	200 000	EUR	205 664	198 718	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 0.30% 19 - 15.12.24	350 000	EUR	344 464	346 279	0,06
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.06.27	200 000	EUR	204 852	201 570	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.12.29	250 000	EUR	250 312	248 318	0,04
Chubb INA Holdings Inc. 1.40% 19 - 15.06.31	200 000	EUR	204 880	207 022	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 1.55% 18 - 15.03.28	100 000	EUR	101 506	105 344	0,02
Chubb INA Holdings Inc. 1.55% 18 - 15.03.28	200 000	EUR	202 144	210 688	0,04
Chubb INA Holdings Inc. 2.50% 18 - 15.03.38	300 000	EUR	349 912	345 114	0,06
Citigroup Inc. 0.50% 19 - 29.01.22	450 000	EUR	450 086	452 214	0,08
Citigroup Inc. FRN 19 - 10.08.27	600 000	EUR	574 135	583 224	0,10
Citigroup Inc. 0.75% 16 - 26.10.23	665 000	EUR	666 529	673 366	0,11
Citigroup Inc. 1.25% 19 - 04.10.29	459 000	EUR	469 578	476 616	0,08
Citigroup Inc. FRN 20 - 07.06.26	710 000	EUR	713 152	725 478	0,12
Citigroup Inc. 1.375% 14 - 27.10.21	400 000	EUR	406 451	407 024	0,07
Citigroup Inc. 1.50% 16 - 26.10.28	366 000	EUR	377 572	388 476	0,07
Citigroup Inc. FRN 18 - 24.07.26	565 000	EUR	573 103	584 329	0,10
Citigroup Inc. 1.625% 18 - 21.03.28	240 000	EUR	252 421	258 230	0,04
Citigroup Inc. 1.75% 15 - 28.01.25	532 000	EUR	555 475	562 675	0,10
Citigroup Inc. 2.125% 14 - 09.10.26	338 000	EUR	364 916	368 890	0,06
Citigroup Inc. 2.375% 14 - 22.05.24	366 000	EUR	390 301	393 036	0,07
Citigroup Inc. FRN 05 - 25.02.30	100 000	EUR	111 683	113 463	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Coca-Cola Co. 0.125% 19 - 22.09.22	300 000	EUR	300 747	300 105	0,05
Coca-Cola Co. 0.50% 17 - 03.08.24	350 000	EUR	351 917	355 068	0,06
Coca-Cola Co. 0.75% 15 - 03.09.23	650 000	EUR	661 860	660 530	0,11
Coca-Cola Co. 0.75% 19 - 22.09.26	300 000	EUR	306 182	309 174	0,05
Coca-Cola Co. 1.10% 16 - 09.02.36	200 000	EUR	202 931	205 890	0,03
Coca-Cola Co. 1.125% 14 - 22.09.22	82 000	EUR	84 266	83 883	0,01
Coca-Cola Co. 1.125% 14 - 22.09.22	100 000	EUR	101 737	102 296	0,02
Coca-Cola Co. 1.125% 15 - 03.09.27	300 000	EUR	310 819	314 613	0,05
Coca-Cola Co. 1.125% 15 - 03.09.27	200 000	EUR	211 218	209 742	0,04
Coca-Cola Co. 1.25% 19 - 03.08.31	400 000	EUR	420 238	426 536	0,07
Coca-Cola Co. 1.625% 15 - 03.09.35	500 000	EUR	542 586	549 740	0,09
Coca-Cola Co. 1.875% 14 - 22.09.26	400 000	EUR	436 729	440 160	0,07
Colgate-Palmolive Co. Zero Coupon 19 - 11.12.21	200 000	EUR	200 293	199 994	0,03
Colgate-Palmolive Co. 0.50% 19 - 03.06.26	200 000	EUR	200 885	204 458	0,03
Colgate-Palmolive Co. 0.875% 19 - 11.12.39	200 000	EUR	199 594	204 296	0,03
Colgate-Palmolive Co. 1.375% 19 - 03.06.34	200 000	EUR	214 415	224 888	0,04
CyrusOne LP Via CyrusOne Finance Corp. 1.45% 20 - 22.01.27	237 000	EUR	233 055	227 961	0,04
Discovery Communications LLC 1.90% 15 - 19.03.27	200 000	EUR	204 709	203 986	0,03
Discovery Communications LLC 2.375% 14 - 03.07.22	100 000	EUR	102 844	102 034	0,02
Dover Corp. 0.75% 19 - 11.04.27	200 000	EUR	194 775	190 372	0,03
Dover Corp. 1.25% 16 - 11.09.26	300 000	EUR	302 526	300 726	0,05
Dow Chemical Co. 0.50% 20 - 15.03.27	431 000	EUR	408 641	408 196	0,07
Dow Chemical Co. 1.125% 20 - 15.03.32	248 000	EUR	236 754	226 392	0,04
Dow Chemical Co. 1.875% 20 - 15.03.40	166 000	EUR	164 299	153 512	0,03
DXC Technology Co. 1.75% 18 - 15.01.26	200 000	EUR	202 379	196 894	0,03
Ecolab Inc. 1.00% 16 - 15.01.24	300 000	EUR	308 689	308 712	0,05
Ecolab Inc. 2.625% 15 - 07.08.25	100 000	EUR	110 823	110 594	0,02
Eli Lilly & Co. 0.625% 19 - 11.01.31	200 000	EUR	198 850	202 872	0,03
Eli Lilly & Co. 1.00% 15 - 06.02.22	200 000	EUR	203 508	203 270	0,03
Eli Lilly & Co. 1.625% 15 - 06.02.26	300 000	EUR	322 806	326 541	0,06
Eli Lilly & Co. 1.70% 19 - 11.01.49	330 000	EUR	333 628	343 471	0,06
Eli Lilly & Co. 2.125% 15 - 06.03.30	300 000	EUR	344 129	350 370	0,06
Emerson Electric Co. 0.375% 19 - 22.05.24	137 000	EUR	134 125	137 954	0,02
Emerson Electric Co. 1.25% 19 - 15.10.25	100 000	EUR	105 373	105 208	0,02
Emerson Electric Co. 1.25% 19 - 15.10.25	137 000	EUR	137 058	144 135	0,02
Emerson Electric Co. 2.00% 19 - 15.10.29	137 000	EUR	144 946	153 458	0,03
Equinix Inc. 2.875% 17 - 10.01.25	300 000	EUR	308 933	304 869	0,05
Equinix Inc. 2.875% 17 - 02.01.26	300 000	EUR	311 497	305 274	0,05
Equinix Inc. 2.875% 18 - 15.03.24	300 000	EUR	310 075	304 875	0,05
General Mills Inc. 0.45% 20 - 15.01.26	250 000	EUR	243 888	246 208	0,04
General Mills Inc. 1.00% 15 - 27.04.23	100 000	EUR	102 596	101 243	0,02
General Mills Inc. 1.00% 15 - 27.04.23	100 000	EUR	100 745	101 243	0,02
General Mills Inc. 1.50% 15 - 27.04.27	100 000	EUR	102 463	103 397	0,02
Goldman Sachs Group Inc. 0.125% 19 - 19.08.24	300 000	EUR	299 604	292 512	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 20 - 21.01.30	193 000	EUR	193 884	188 876	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 20 - 21.01.30	257 000	EUR	246 279	251 508	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Goldman Sachs Group Inc. 1.25% 16 - 05.01.25	450 000	EUR	456 689	455 967	0,08
Goldman Sachs Group Inc. 1.375% 15 - 26.07.22	450 000	EUR	461 565	458 874	0,08
Goldman Sachs Group Inc. 1.375% 17 - 15.05.24	752 000	EUR	763 925	765 844	0,13
Goldman Sachs Group Inc. 1.625% 16 - 27.07.26	820 000	EUR	847 082	856 974	0,15
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 15 - 27.07.23	550 000	EUR	574 976	573 171	0,10
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 22.03.28	250 000	EUR	260 935	269 655	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 11.01.28	450 000	EUR	469 723	486 837	0,08
Goldman Sachs Group Inc. 2.125% 14 - 30.09.24	400 000	EUR	419 539	421 960	0,07
Goldman Sachs Group Inc. 2.50% 14 - 18.10.21	400 000	EUR	412 388	411 968	0,07
Goldman Sachs Group Inc. 2.875% 14 - 06.03.26	351 000	EUR	384 681	390 544	0,07
Goldman Sachs Group Inc. 3.00% 16 - 02.12.31	407 000	EUR	476 646	480 622	0,08
Goldman Sachs Group Inc. 3.25% 13 - 02.01.23	300 000	EUR	320 136	321 117	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 3.375% 20 - 27.03.25	753 000	EUR	806 270	840 115	0,14
Harley-Davidson Financial Services Inc. 0.90% 19 - 19.11.24	200 000	EUR	203 159	187 940	0,03
Harley-Davidson Financial Services Inc. 3.875% 20 - 19.05.23	300 000	EUR	307 037	313 554	0,05
Illinois Tool Works Inc. 0.25% 19 - 12.05.24	100 000	EUR	99 589	100 007	0,02
Illinois Tool Works Inc. 0.25% 19 - 12.05.24	200 000	EUR	200 510	200 014	0,03
Illinois Tool Works Inc. 0.625% 19 - 12.05.27	200 000	EUR	199 648	201 216	0,03
Illinois Tool Works Inc. 1.00% 19 - 06.05.31	200 000	EUR	201 984	205 484	0,03
Illinois Tool Works Inc. 1.25% 15 - 22.05.23	200 000	EUR	206 462	206 208	0,03
Illinois Tool Works Inc. 1.75% 14 - 20.05.22	200 000	EUR	206 346	205 568	0,03
Illinois Tool Works Inc. 2.125% 15 - 22.05.30	200 000	EUR	220 986	226 696	0,04
Illinois Tool Works Inc. 3.00% 14 - 19.05.34	100 000	EUR	120 847	125 875	0,02
International Business Machines Corp. 0.30% 20 - 02.11.28	531 000	EUR	526 072	517 029	0,09
International Business Machines Corp. 0.375% 19 - 31.01.23	100 000	EUR	101 010	100 426	0,02
International Business Machines Corp. 0.375% 19 - 31.01.23	500 000	EUR	501 429	502 130	0,09
International Business Machines Corp. 0.50% 16 - 09.07.21	400 000	EUR	402 939	402 100	0,07
International Business Machines Corp. 0.65% 20 - 02.11.32	430 000	EUR	425 151	414 864	0,07
International Business Machines Corp. 0.875% 19 - 31.01.25	300 000	EUR	305 483	307 494	0,05
International Business Machines Corp. 0.95% 17 - 23.05.25	400 000	EUR	408 233	411 988	0,07
International Business Machines Corp. 1.125% 16 - 09.06.24	200 000	EUR	207 938	207 098	0,04
International Business Machines Corp. 1.125% 16 - 09.06.24	100 000	EUR	103 345	103 549	0,02
International Business Machines Corp. 1.20% 20 - 02.11.40	282 000	EUR	275 106	269 908	0,05
International Business Machines Corp. 1.25% 14 - 26.05.23	300 000	EUR	309 540	309 018	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
International Business Machines Corp. 1.25% 19 - 29.01.27	350 000	EUR	365 121	365 645	0,06
International Business Machines Corp. 1.50% 17 - 23.05.29	400 000	EUR	423 853	427 260	0,07
International Business Machines Corp. 1.75% 16 - 03.07.28	200 000	EUR	214 487	216 086	0,04
International Business Machines Corp. 1.75% 19 - 31.01.31	550 000	EUR	586 750	599 775	0,10
International Business Machines Corp. 2.875% 13 - 11.07.25	400 000	EUR	451 631	452 016	0,08
Johnson & Johnson 0.25% 16 - 20.01.22	540 000	EUR	543 929	544 487	0,09
Johnson & Johnson 0.65% 16 - 20.05.24	300 000	EUR	307 772	308 751	0,05
Johnson & Johnson 1.15% 16 - 20.11.28	200 000	EUR	209 266	219 188	0,04
Johnson & Johnson 1.65% 16 - 20.05.35	500 000	EUR	566 674	587 935	0,10
Johnson & Johnson 1.65% 16 - 20.05.35	100 000	EUR	106 374	117 587	0,02
Kellogg Co. 0.80% 17 - 17.11.22	250 000	EUR	254 149	252 260	0,04
Kellogg Co. 1.00% 16 - 17.05.24	200 000	EUR	203 456	202 950	0,03
Kellogg Co. 1.25% 15 - 03.10.25	100 000	EUR	105 041	102 300	0,02
Kellogg Co. 1.25% 15 - 03.10.25	100 000	EUR	105 396	102 300	0,02
Kimberly-Clark Corp. 0.625% 17 - 09.07.24	100 000	EUR	100 807	102 223	0,02
ManpowerGroup Inc. 1.75% 18 - 22.06.26	200 000	EUR	206 782	203 460	0,03
ManpowerGroup Inc. 1.875% 15 - 09.11.22	200 000	EUR	204 993	205 050	0,03
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.349% 19 - 21.09.26	100 000	EUR	97 150	104 576	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.349% 19 - 21.09.26	100 000	EUR	104 317	104 576	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.979% 19 - 21.03.30	100 000	EUR	104 927	110 081	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.979% 19 - 21.03.30	100 000	EUR	102 449	110 081	0,02
Mastercard Inc. 1.10% 15 - 12.01.22	100 000	EUR	101 721	102 213	0,02
Mastercard Inc. 1.10% 15 - 12.01.22	200 000	EUR	204 982	204 426	0,03
Mastercard Inc. 2.10% 15 - 12.01.27	300 000	EUR	340 609	340 380	0,06
Merck & Co. Inc. 0.50% 16 - 11.02.24	200 000	EUR	200 542	204 356	0,03
Merck & Co. Inc. 1.125% 14 - 15.10.21	300 000	EUR	304 422	303 528	0,05
Merck & Co. Inc. 1.375% 16 - 11.02.36	200 000	EUR	218 595	218 086	0,04
Merck & Co. Inc. 1.875% 14 - 15.10.26	150 000	EUR	164 796	166 013	0,03
Merck & Co. Inc. 1.875% 14 - 15.10.26	200 000	EUR	218 179	221 350	0,04
Merck & Co. Inc. 2.50% 14 - 15.10.34	200 000	EUR	241 094	250 130	0,04
Microsoft Corp. 2.125% 13 - 12.06.21	458 000	EUR	471 555	470 164	0,08
Microsoft Corp. 2.625% 13 - 05.02.33	200 000	EUR	249 017	256 108	0,04
Microsoft Corp. 3.125% 13 - 12.06.28	650 000	EUR	790 069	812 162	0,14
MMS USA Investments Inc. 0.625% 19 - 13.06.25	300 000	EUR	290 526	286 878	0,05
MMS USA Investments Inc. 1.25% 19 - 13.06.28	300 000	EUR	294 837	285 570	0,05
MMS USA Investments Inc. 1.75% 19 - 13.06.31	300 000	EUR	301 858	286 326	0,05
Mohawk Industries Inc. 2.00% 15 - 14.01.22	200 000	EUR	204 491	203 982	0,03
Mondelez International Inc. 1.00% 15 - 03.07.22	200 000	EUR	203 425	202 340	0,03
Mondelez International Inc. 1.625% 15 - 03.08.27	208 000	EUR	216 288	219 704	0,04
Mondelez International Inc. 1.625% 15 - 03.08.27	100 000	EUR	100 872	105 627	0,02
Mondelez International Inc. 1.625% 16 - 20.01.23	200 000	EUR	205 749	206 628	0,03
Mondelez International Inc. 2.375% 15 - 03.06.35	100 000	EUR	106 728	110 071	0,02
Moody's Corp. 0.95% 19 - 25.02.30	300 000	EUR	305 415	307 092	0,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Moody's Corp. 1.75% 15 - 03.09.27	200 000	EUR	210 637	215 980	0,04
Morgan Stanley FRN 19 - 26.07.24	600 000	EUR	603 808	600 456	0,10
Morgan Stanley 1.00% 16 - 12.02.22	400 000	EUR	407 103	404 692	0,07
Morgan Stanley FRN 17 - 23.10.26	400 000	EUR	408 818	412 576	0,07
Morgan Stanley 1.375% 16 - 27.10.26	400 000	EUR	407 842	418 216	0,07
Morgan Stanley 1.75% 15 - 30.01.25	600 000	EUR	626 250	631 674	0,11
Morgan Stanley 1.75% 16 - 03.11.24	573 000	EUR	600 162	598 544	0,10
Morgan Stanley 1.875% 14 - 30.03.23	500 000	EUR	520 102	519 045	0,09
Morgan Stanley 1.875% 17 - 27.04.27	800 000	EUR	856 055	866 336	0,15
National Grid North America Inc. 0.75% 15 - 02.11.22	400 000	EUR	402 416	402 600	0,07
National Grid North America Inc. 0.75% 18 - 08.08.23	100 000	EUR	100 293	101 408	0,02
National Grid North America Inc. 1.00% 17 - 07.12.24	100 000	EUR	102 110	102 834	0,02
Nestle Holdings Inc. 0.875% 17 - 18.07.25	300 000	EUR	311 809	312 927	0,05
Oracle Corp. 3.125% 13 - 07.10.25	350 000	EUR	399 606	400 816	0,07
Parker Hannifin Corp. 1.125% 17 - 03.01.25	300 000	EUR	301 514	301 281	0,05
PepsiCo Inc. 0.25% 20 - 05.06.24	260 000	EUR	260 072	261 607	0,04
PepsiCo Inc. 0.50% 20 - 05.06.28	400 000	EUR	399 768	403 336	0,07
PepsiCo Inc. 0.75% 19 - 18.03.27	300 000	EUR	306 891	310 839	0,05
PepsiCo Inc. 0.875% 16 - 18.07.28	300 000	EUR	310 462	313 728	0,05
PepsiCo Inc. 0.875% 19 - 16.10.39	120 000	EUR	119 705	118 057	0,02
PepsiCo Inc. 1.125% 19 - 18.03.31	200 000	EUR	213 376	211 680	0,04
PepsiCo Inc. 2.625% 14 - 28.04.26	100 000	EUR	113 045	114 005	0,02
PerkinElmer Inc. 1.875% 16 - 19.07.26	200 000	EUR	203 977	205 436	0,03
PPG Industries Inc. 0.875% 15 - 13.03.22	300 000	EUR	302 814	301 782	0,05
PPG Industries Inc. 0.875% 16 - 11.03.25	200 000	EUR	200 631	203 214	0,03
PPG Industries Inc. 1.40% 15 - 13.03.27	200 000	EUR	203 821	205 774	0,03
Praxair Inc. 1.20% 16 - 02.12.24	200 000	EUR	210 146	208 688	0,04
Praxair Inc. 1.625% 14 - 12.01.25	150 000	EUR	164 025	161 133	0,03
Procter & Gamble Co. 0.50% 17 - 25.10.24	300 000	EUR	304 317	308 190	0,05
Procter & Gamble Co. 0.625% 18 - 30.10.24	300 000	EUR	306 745	309 342	0,05
Procter & Gamble Co. 1.125% 15 - 11.02.23	500 000	EUR	518 550	520 880	0,09
Procter & Gamble Co. 1.20% 18 - 30.10.28	350 000	EUR	376 426	382 851	0,06
Procter & Gamble Co. 1.25% 17 - 25.10.29	100 000	EUR	106 531	109 699	0,02
Procter & Gamble Co. 1.875% 18 - 30.10.38	200 000	EUR	239 783	240 954	0,04
Procter & Gamble Co. 2.00% 12 - 16.08.22	407 000	EUR	425 557	425 099	0,07
Procter & Gamble Co. 2.00% 13 - 11.05.21	200 000	EUR	206 148	205 684	0,03
Procter & Gamble Co. 4.875% 07 - 05.11.27	55 000	EUR	69 526	73 353	0,01
Procter & Gamble Co. 4.875% 07 - 05.11.27	250 000	EUR	325 044	333 422	0,06
Prologis Euro Finance LLC 0.25% 19 - 09.10.27	300 000	EUR	291 936	293 550	0,05
Prologis Euro Finance LLC 0.375% 20 - 02.06.28	200 000	EUR	196 797	196 274	0,03
Prologis Euro Finance LLC 0.625% 19 - 09.10.31	200 000	EUR	199 475	192 646	0,03
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 20 - 02.06.35	300 000	EUR	290 676	291 057	0,05
Prologis Euro Finance LLC 1.50% 19 - 09.10.49	100 000	EUR	97 266	95 521	0,02
Prologis Euro Finance LLC 1.875% 18 - 01.05.29	300 000	EUR	325 368	327 120	0,06
Prologis LP 3.00% 13 - 18.01.22	200 000	EUR	208 627	207 384	0,04
Prologis LP 3.00% 14 - 06.02.26	200 000	EUR	221 158	229 628	0,04
Prologis LP 3.375% 14 - 20.02.24	300 000	EUR	331 389	331 113	0,06
PVH Corp. 3.125% 17 - 15.12.27	200 000	EUR	219 113	192 590	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
PVH Corp. 3.625% 16 - 15.07.24	200 000	EUR	209 185	203 882	0,03
RELX Capital Inc. 1.30% 15 - 05.12.25	200 000	EUR	209 139	208 446	0,04
Sysco Corp. 1.25% 16 - 23.06.23	200 000	EUR	198 400	198 676	0,03
Toyota Motor Credit Corp. Zero Coupon 17 - 21.07.21	200 000	EUR	200 234	199 636	0,03
Toyota Motor Credit Corp. 0.25% 20 - 16.07.26	274 000	EUR	275 473	269 537	0,05
Toyota Motor Credit Corp. 0.25% 20 - 16.07.26	100 000	EUR	98 325	98 371	0,02
Toyota Motor Credit Corp. 0.625% 17 - 21.11.24	100 000	EUR	100 523	101 190	0,02
Toyota Motor Credit Corp. 0.75% 15 - 21.07.22	500 000	EUR	509 053	505 130	0,09
Toyota Motor Credit Corp. 1.00% 14 - 09.10.21	400 000	EUR	403 096	403 756	0,07
Toyota Motor Credit Corp. 2.375% 13 - 02.01.23	109 000	EUR	115 402	114 817	0,02
United Parcel Service Inc. 0.375% 17 - 15.11.23	200 000	EUR	202 227	201 306	0,03
United Parcel Service Inc. 1.00% 16 - 15.11.28	200 000	EUR	201 743	205 420	0,03
United Parcel Service Inc. 1.50% 17 - 15.11.32	200 000	EUR	209 120	215 100	0,04
United Parcel Service Inc. 1.625% 15 - 15.11.25	100 000	EUR	103 505	106 707	0,02
United Parcel Service Inc. 1.625% 15 - 15.11.25	100 000	EUR	107 225	106 707	0,02
VF Corp. 0.25% 20 - 25.02.28	166 000	EUR	166 493	156 920	0,03
VF Corp. 0.625% 16 - 20.09.23	300 000	EUR	302 910	301 290	0,05
VF Corp. 0.625% 20 - 25.02.32	200 000	EUR	189 012	182 474	0,03
WP Carey Inc. 2.00% 15 - 20.01.23	100 000	EUR	103 896	102 195	0,02
WP Carey Inc. 2.00% 15 - 20.01.23	100 000	EUR	103 946	102 195	0,02
Xylem Inc. 2.25% 16 - 03.11.23	100 000	EUR	104 730	103 655	0,02
Xylem Inc. 2.25% 16 - 03.11.23	50 000	EUR	52 743	51 828	0,01
			75 484 662	75 867 528	12,86
Total - Obligations			584 848 211	585 901 970	99,31
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			584 848 211	585 901 970	99,31

Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire^(A)

Obligations

États-Unis

AbbVie Inc. 1.25% 20 - 06.01.24	190 000	EUR	193 220	194 214	0,03
AbbVie Inc. 1.50% 20 - 15.11.23	230 000	EUR	236 885	237 544	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
AbbVie Inc. 2.125% 20 - 06.01.29	120 000	EUR	128 898	131 338	0,02
AbbVie Inc. 2.625% 20 - 15.11.28	230 000	EUR	257 487	260 615	0,05
			816 490	823 711	0,14
Total - Obligations			816 490	823 711	0,14
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			816 490	823 711	0,14
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			585 664 701	586 725 681	99,45
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				590 734 955	100,13

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 94 - 01.04.24	5 300 000	EUR	5 419 976	5 422 748	5,92
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 01.04.21	7 100 000	EUR	7 119 328	7 125 418	7,78
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.21	500 000	EUR	502 320	502 605	0,55
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 01.04.22	3 100 000	EUR	3 119 630	3 131 713	3,42
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.22	400 000	EUR	406 401	405 260	0,44
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 01.04.23	7 300 000	EUR	7 421 500	7 420 961	8,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.23	5 100 000	EUR	5 157 713	5 200 368	5,68
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.25	17 000 000	EUR	17 237 558	17 552 500	19,16
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.27	600 000	EUR	626 233	621 348	0,68
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 01.04.25	3 200 000	EUR	3 254 277	3 292 544	3,59
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 01.04.26	200 000	EUR	205 866	207 030	0,23
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.29	1 200 000	EUR	1 284 323	1 249 320	1,36
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.30	300 000	EUR	308 839	312 198	0,34
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 03 - 07.04.31	6 000 000	EUR	6 084 034	6 259 440	6,83
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 05 - 01.04.34	1 300 000	EUR	1 334 743	1 351 519	1,48
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 07 - 07.04.36	5 900 000	EUR	5 851 711	6 133 699	6,69
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 07 - 07.04.37	4 200 000	EUR	4 269 884	4 334 820	4,73
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 10 - 07.04.42	900 000	EUR	910 111	911 493	0,99
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 13 - 15.08.22	3 200 000	EUR	3 222 547	3 243 328	3,54
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 13 - 15.08.23	300 000	EUR	307 098	306 009	0,33
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 14 - 15.08.25	100 000	EUR	102 691	103 123	0,11

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 14 - 15.08.40	11 900 000	EUR	12 168 743	12 144 307	13,26
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 00 - 01.04.31	4 000 000	EUR	4 169 259	4 174 640	4,56
			90 484 785	91 406 391	99,77
Total - Obligations			90 484 785	91 406 391	99,77
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			90 484 785	91 406 391	99,77
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			90 484 785	91 406 391	99,77
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				91 406 391	99,77

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Irlande					
Ireland Zero Coupon 17 - 18.10.22	1 492 000	EUR	1 497 630	1 510 089	0,18
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	1 721 000	EUR	1 751 929	1 772 203	0,21
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	1 122 000	EUR	1 154 215	1 146 829	0,14
Ireland 0.80% 15 - 15.03.22	1 998 000	EUR	2 036 244	2 043 468	0,24
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	2 344 000	EUR	2 397 358	2 544 658	0,30
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	3 173 000	EUR	3 294 014	3 419 649	0,40
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	2 765 000	EUR	2 921 868	3 059 870	0,36
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	1 281 000	EUR	1 342 689	1 473 240	0,17
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	1 520 000	EUR	1 628 463	1 736 015	0,20
Ireland 1.50% 19 - 15.05.50	1 383 000	EUR	1 467 786	1 705 185	0,20
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	1 684 000	EUR	1 804 157	2 064 702	0,24
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	2 492 000	EUR	2 776 844	3 366 369	0,40
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	2 685 000	EUR	3 091 974	3 335 933	0,39
Ireland 3.40% 14 - 18.03.24	2 186 000	EUR	2 459 270	2 500 951	0,29
Ireland 3.90% 13 - 20.03.23	2 090 000	EUR	2 322 633	2 342 789	0,28
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	3 318 000	EUR	4 115 903	4 232 511	0,50
			36 062 977	38 254 461	4,50
Italie					
Italy 5.125% 04 - 31.07.24	1 000 000	EUR	1 182 482	1 173 204	0,14
Italy 5.20% 04 - 31.07.34	80 000	EUR	116 979	110 944	0,01
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.05% 19 - 15.01.23	4 492 000	EUR	4 489 187	4 477 546	0,53
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 16 - 11.01.21	4 385 000	EUR	4 350 837	4 410 170	0,52
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 19 - 02.01.25	5 868 000	EUR	5 782 391	5 803 247	0,68
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.45% 16 - 06.01.21	4 373 000	EUR	4 355 100	4 395 638	0,52
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.60% 20 - 15.06.23	4 165 000	EUR	4 152 979	4 208 079	0,49
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.65% 16 - 15.10.23	4 954 000	EUR	4 798 086	5 011 898	0,59
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.85% 19 - 15.01.27	4 446 000	EUR	4 401 222	4 428 483	0,52
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.90% 17 - 08.01.22	5 014 000	EUR	4 970 055	5 098 060	0,60
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 16 - 15.03.23	4 764 000	EUR	4 682 447	4 857 589	0,57
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 18 - 03.01.23	4 841 000	EUR	4 779 705	4 935 823	0,58
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 20 - 08.01.30	3 102 000	EUR	2 890 533	3 017 936	0,35
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	2 072 000	EUR	2 069 811	2 110 987	0,25
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	1 600 000	EUR	1 624 517	1 630 106	0,19
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.20% 17 - 04.01.22	4 600 000	EUR	4 595 057	4 690 171	0,55
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.25% 16 - 12.01.26	5 551 000	EUR	5 324 618	5 685 735	0,67
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 15 - 15.04.22	5 440 000	EUR	5 454 542	5 563 257	0,65
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 19 - 04.01.30	6 312 000	EUR	6 433 595	6 387 870	0,75
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 15 - 15.09.22	4 937 000	EUR	4 958 075	5 079 767	0,60
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 17 - 15.11.24	4 488 000	EUR	4 409 143	4 662 093	0,55
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 18 - 15.05.25	4 338 000	EUR	4 208 448	4 501 285	0,53
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 18 - 15.05.25	40 000	EUR	42 008	41 506	0,00
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 20 - 03.01.36	3 050 000	EUR	3 003 213	2 961 504	0,35
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.50% 15 - 06.01.25	5 237 000	EUR	5 097 265	5 450 121	0,64
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.50% 15 - 06.01.25	713 000	EUR	732 001	742 016	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.60% 16 - 06.01.26	5 877 000	EUR	5 760 403	6 148 642	0,72
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.65% 15 - 03.01.32	6 520 000	EUR	5 960 863	6 703 809	0,79
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.75% 19 - 07.01.24	4 819 000	EUR	4 970 813	5 055 236	0,59
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.85% 17 - 15.05.24	4 653 000	EUR	4 627 562	4 900 453	0,58

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.85% 20 - 07.01.25	2 616 000	EUR	2 691 908	2 761 384	0,32
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 15 - 12.01.25	5 855 000	EUR	5 888 480	6 249 866	0,73
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 18 - 02.01.28	6 932 000	EUR	6 873 668	7 425 177	0,87
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.05% 17 - 08.01.27	5 538 000	EUR	5 417 197	5 944 118	0,70
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.10% 19 - 15.07.26	4 960 000	EUR	5 172 634	5 323 786	0,63
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.15% 14 - 15.12.21	5 235 000	EUR	5 323 973	5 403 986	0,64
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.20% 17 - 06.01.27	5 061 000	EUR	5 090 514	5 483 207	0,64
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.25% 16 - 09.01.36	4 389 000	EUR	4 115 318	4 729 309	0,56
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.30% 18 - 15.10.21	4 552 000	EUR	4 617 572	4 692 378	0,55
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 17 - 09.01.33	4 784 000	EUR	4 581 187	5 303 330	0,62
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 18 - 10.01.23	5 298 000	EUR	5 427 313	5 663 588	0,67
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 20 - 09.01.50	3 719 000	EUR	3 912 252	3 910 566	0,46
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.50% 14 - 12.01.24	6 094 000	EUR	6 247 496	6 599 521	0,78
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.50% 18 - 15.11.25	4 831 000	EUR	4 924 154	5 277 890	0,62
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.70% 16 - 03.01.47	5 132 000	EUR	4 852 251	5 707 049	0,67
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.80% 16 - 03.01.67	2 793 000	EUR	2 609 213	3 109 831	0,37
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.80% 18 - 12.01.28	5 755 000	EUR	5 847 267	6 541 226	0,77
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.95% 18 - 09.01.38	4 501 000	EUR	4 427 464	5 257 651	0,62
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.00% 19 - 08.01.29	6 016 000	EUR	6 560 750	6 969 706	0,82
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.10% 19 - 03.01.40	3 141 000	EUR	3 526 746	3 739 597	0,44
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.25% 15 - 09.01.46	4 616 000	EUR	4 739 528	5 627 471	0,66
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.35% 19 - 03.01.35	4 123 000	EUR	4 499 593	5 026 822	0,59
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	4 617 000	EUR	4 849 343	5 833 512	0,69
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 17 - 03.01.48	53 000	EUR	69 103	66 965	0,01
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.50% 14 - 03.01.30	7 405 000	EUR	7 986 347	8 938 059	1,05
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.75% 06 - 08.01.21	8 049 000	EUR	8 284 584	8 386 334	0,99
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.75% 14 - 09.01.24	5 864 000	EUR	6 297 876	6 633 227	0,78
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.85% 19 - 09.01.49	3 901 000	EUR	4 539 035	5 275 419	0,62
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.00% 05 - 02.01.37	7 915 000	EUR	9 060 361	10 397 658	1,22
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 10 - 03.01.26	6 231 000	EUR	6 984 384	7 510 867	0,88
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 05.01.23	5 501 000	EUR	5 942 057	6 161 340	0,72
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 05.01.23	255 000	EUR	275 598	285 610	0,03
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 03.01.24	6 960 000	EUR	7 639 062	7 986 214	0,94
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 08 - 08.01.23	7 128 000	EUR	7 791 194	8 102 116	0,95
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 11 - 09.01.21	7 336 000	EUR	7 653 300	7 750 264	0,91
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 13 - 09.01.28	6 799 000	EUR	7 904 507	8 744 452	1,03
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 13 - 09.01.44	5 224 000	EUR	6 604 242	7 828 454	0,92
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 03 - 08.01.34	7 586 000	EUR	9 537 968	10 779 739	1,27
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 07 - 08.01.39	6 382 000	EUR	8 090 265	9 538 621	1,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 09 - 03.01.25	6 927 000	EUR	7 839 122	8 316 974	0,98
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 09 - 09.01.40	6 372 000	EUR	8 011 118	9 568 700	1,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 11 - 03.01.22	6 110 000	EUR	6 503 766	6 618 543	0,78
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.25% 98 - 11.01.29	8 175 000	EUR	10 028 387	11 098 929	1,30
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.50% 12 - 09.01.22	5 808 000	EUR	6 312 833	6 483 949	0,76
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.50% 12 - 11.01.22	6 258 000	EUR	6 849 710	7 032 056	0,83
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.75% 02 - 02.01.33	6 210 000	EUR	8 210 575	9 210 299	1,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.00% 00 - 05.01.31	8 588 000	EUR	11 259 400	12 576 310	1,48
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.50% 97 - 11.01.27	7 448 000	EUR	9 488 294	10 302 006	1,21

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 7.25% 97 - 11.01.26	3 601 000	EUR	4 685 017	5 011 210	0,59
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9.00% 93 - 11.01.23	3 367 000	EUR	4 185 613	4 331 511	0,51
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 19 - 29.06.21	4 271 000	EUR	4 260 179	4 274 039	0,50
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 19 - 29.11.21	5 122 000	EUR	5 109 309	5 120 666	0,60
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 20 - 30.05.22	1 294 000	EUR	1 282 483	1 289 754	0,15
			431 105 447	462 444 431	54,35
Portugal					
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 0.475% 20 - 18.10.30	1 547 000	EUR	1 571 591	1 546 602	0,18
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 0.70% 20 - 15.10.27	1 449 000	EUR	1 465 457	1 502 090	0,18
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.95% 19 - 15.06.29	3 078 000	EUR	3 357 086	3 505 488	0,41
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.95% 19 - 15.06.29	118 000	EUR	133 238	134 388	0,02
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.125% 18 - 17.10.28	3 314 000	EUR	3 510 958	3 809 357	0,45
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.20% 15 - 17.10.22	3 073 000	EUR	3 218 628	3 262 758	0,38
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.25% 18 - 18.04.34	1 997 000	EUR	2 237 900	2 382 012	0,28
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.875% 15 - 15.10.25	4 131 000	EUR	4 542 436	4 778 245	0,56
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.875% 16 - 21.07.26	3 212 000	EUR	3 572 758	3 773 672	0,44
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 3.875% 14 - 15.02.30	1 672 000	EUR	2 038 613	2 212 808	0,26
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 3.875% 14 - 15.02.30	53 000	EUR	64 311	70 143	0,01
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.10% 06 - 15.04.37	2 619 000	EUR	3 339 759	3 895 949	0,46
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.10% 15 - 15.02.45	1 134 000	EUR	1 517 475	1 809 263	0,21
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.125% 17 - 14.04.27	2 637 000	EUR	3 145 957	3 353 810	0,40
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.95% 08 - 25.10.23	3 641 000	EUR	4 192 890	4 287 180	0,50
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 5.65% 13 - 15.02.24	3 563 000	EUR	4 191 101	4 338 736	0,51
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 5.65% 13 - 15.02.24	10 000	EUR	11 890	12 177	0,00
			42 112 048	44 674 678	5,25
Slovénie					
Slovenia 0.20% 20 - 31.03.23	520 000	EUR	522 849	526 297	0,06
Slovenia 1.00% 18 - 03.06.28	683 000	EUR	689 137	732 457	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Slovénie (suite)					
Slovenia 1.188% 19 - 14.03.29	570 000	EUR	600 439	618 786	0,07
Slovenia 1.25% 17 - 22.03.27	909 000	EUR	950 294	987 968	0,12
Slovenia 1.50% 15 - 25.03.35	655 000	EUR	672 835	735 657	0,09
Slovenia 1.75% 16 - 11.03.40	897 000	EUR	937 190	1 045 303	0,12
Slovenia 2.125% 15 - 28.07.25	534 000	EUR	583 137	595 338	0,07
Slovenia 2.25% 16 - 03.03.32	580 000	EUR	653 677	704 336	0,08
			5 609 558	5 946 142	0,70
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 30.04.23	4 352 000	EUR	4 381 959	4 389 287	0,52
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	3 422 000	EUR	3 428 694	3 443 751	0,40
Spain 0.05% 18 - 31.10.21	5 837 000	EUR	5 860 402	5 874 971	0,69
Spain 0.25% 19 - 30.07.24	4 886 000	EUR	4 963 141	4 979 195	0,58
Spain 0.35% 18 - 30.07.23	6 303 000	EUR	6 342 908	6 428 634	0,75
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	5 338 000	EUR	5 373 388	5 418 076	0,64
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	480 000	EUR	486 878	487 200	0,06
Spain 0.45% 17 - 31.10.22	5 655 000	EUR	5 707 905	5 765 697	0,68
Spain 0.50% 20 - 30.04.30	5 134 000	EUR	5 208 214	5 183 675	0,61
Spain 0.60% 19 - 31.10.29	6 160 000	EUR	6 326 878	6 302 972	0,74
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	4 853 000	EUR	4 900 996	4 917 157	0,58
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	1 495 000	EUR	1 510 512	1 514 764	0,18
Spain 0.80% 20 - 30.07.27	3 629 000	EUR	3 723 874	3 794 170	0,45
Spain 1.00% 20 - 31.10.50	2 533 000	EUR	2 268 540	2 364 848	0,28
Spain 1.25% 20 - 31.10.30	5 226 000	EUR	5 493 591	5 637 618	0,66
Spain 1.30% 16 - 31.10.26	7 223 000	EUR	7 452 908	7 799 251	0,92
Spain 1.40% 18 - 30.04.28	6 243 000	EUR	6 366 173	6 820 888	0,80
Spain 1.40% 18 - 30.07.28	6 246 000	EUR	6 351 711	6 831 524	0,80
Spain 1.45% 17 - 31.10.27	6 146 000	EUR	6 305 499	6 719 035	0,79
Spain 1.45% 19 - 30.04.29	5 363 000	EUR	5 541 541	5 892 116	0,69
Spain 1.45% 19 - 30.04.29	606 000	EUR	670 155	665 788	0,08
Spain 1.50% 17 - 30.04.27	5 879 000	EUR	6 112 682	6 442 406	0,76
Spain 1.60% 15 - 30.04.25	6 017 000	EUR	6 293 966	6 523 000	0,77
Spain 1.85% 19 - 30.07.35	3 848 000	EUR	4 208 003	4 425 241	0,52
Spain 1.95% 15 - 30.07.30	6 533 000	EUR	6 908 483	7 517 479	0,88
Spain 1.95% 16 - 30.04.26	5 997 000	EUR	6 448 662	6 688 274	0,79
Spain 2.15% 15 - 31.10.25	5 367 000	EUR	5 766 735	6 005 053	0,71
Spain 2.15% 15 - 31.10.25	1 669 000	EUR	1 800 350	1 867 418	0,22
Spain 2.35% 17 - 30.07.33	5 790 000	EUR	6 334 815	7 013 498	0,82
Spain 2.70% 18 - 31.10.48	3 991 000	EUR	4 752 160	5 389 572	0,63
Spain 2.75% 14 - 31.10.24	7 032 000	EUR	7 732 147	7 928 817	0,93
Spain 2.90% 16 - 31.10.46	5 222 000	EUR	5 983 068	7 234 533	0,85
Spain 3.45% 16 - 30.07.66	3 851 000	EUR	5 210 052	6 337 514	0,74
Spain 3.80% 14 - 30.04.24	5 913 000	EUR	6 668 813	6 834 759	0,80
Spain 4.20% 05 - 31.01.37	5 976 000	EUR	8 005 817	9 089 599	1,07
Spain 4.40% 13 - 31.10.23	6 010 000	EUR	6 818 643	6 957 430	0,82
Spain 4.65% 10 - 30.07.25	6 639 000	EUR	8 001 709	8 248 685	0,97
Spain 4.70% 09 - 30.07.41	5 908 000	EUR	8 729 115	9 996 478	1,17
Spain 4.80% 08 - 31.01.24	5 295 000	EUR	6 117 946	6 261 462	0,74
Spain 4.90% 07 - 30.07.40	5 426 000	EUR	8 187 508	9 279 464	1,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain 5.15% 13 - 31.10.28	5 075 000	EUR	6 621 698	7 111 240	0,84
Spain 5.15% 13 - 31.10.28	118 000	EUR	159 943	165 345	0,02
Spain 5.15% 13 - 31.10.44	4 072 000	EUR	6 444 204	7 544 981	0,89
Spain 5.40% 13 - 31.01.23	5 974 000	EUR	6 789 152	6 864 575	0,81
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	6 486 000	EUR	9 646 593	10 416 792	1,22
Spain 5.85% 11 - 31.01.22	6 737 000	EUR	7 369 862	7 409 891	0,87
Spain 5.90% 11 - 30.07.26	6 356 000	EUR	8 272 679	8 631 302	1,01
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	7 630 000	EUR	10 604 946	11 317 243	1,33
			274 655 618	290 732 668	34,17
Total - Obligations			789 545 648	842 052 380	98,97
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			789 545 648	842 052 380	98,97
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			789 545 648	842 052 380	98,97
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				850 272 318	99,94

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en AUD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Australie					
Australia 0.25% 20 - 21.11.24	1 258 000	AUD	1 250 796	1 251 433	2,94
Australia 1.00% 20 - 21.12.30	1 350 000	AUD	1 359 513	1 358 978	3,20
Australia 1.25% 20 - 21.05.32	918 000	AUD	945 063	944 907	2,22
Australia 1.50% 19 - 21.06.31	1 522 000	AUD	1 583 518	1 609 058	3,79
Australia 2.00% 17 - 21.12.21	1 131 000	AUD	1 144 172	1 159 954	2,73
Australia 2.25% 16 - 21.05.28	1 890 000	AUD	1 987 779	2 110 544	4,96
Australia 2.25% 16 - 21.05.28	201 000	AUD	199 221	224 455	0,53
Australia 2.25% 17 - 21.11.22	1 701 000	AUD	1 753 858	1 781 338	4,19
Australia 2.50% 18 - 21.05.30	2 059 000	AUD	2 269 221	2 374 212	5,58
Australia 2.75% 12 - 21.04.24	1 943 000	AUD	2 058 333	2 121 698	4,99
Australia 2.75% 12 - 21.04.24	234 000	AUD	239 754	255 521	0,60
Australia 2.75% 15 - 21.06.35	556 000	AUD	613 355	673 105	1,58
Australia 2.75% 16 - 21.11.27	388 000	AUD	389 843	446 320	1,05
Australia 2.75% 16 - 21.11.27	1 579 000	AUD	1 723 874	1 816 339	4,27
Australia 2.75% 17 - 21.11.28	1 797 000	AUD	1 950 991	2 085 059	4,91
Australia 2.75% 18 - 21.11.29	1 729 000	AUD	1 919 534	2 024 209	4,76
Australia 2.75% 18 - 21.11.29	166 000	AUD	170 766	194 343	0,46
Australia 2.75% 18 - 21.05.41	466 000	AUD	540 109	558 100	1,31
Australia 3.00% 16 - 21.03.47	936 000	AUD	1 067 795	1 186 502	2,79
Australia 3.25% 12 - 21.04.29	2 112 000	AUD	2 396 090	2 549 290	6,00
Australia 3.25% 13 - 21.04.25	1 848 000	AUD	2 015 305	2 097 665	4,93
Australia 3.25% 13 - 21.04.25	222 000	AUD	232 715	251 992	0,59
Australia 3.25% 15 - 21.06.39	115 000	AUD	114 342	147 528	0,35
Australia 3.25% 15 - 21.06.39	524 000	AUD	630 331	672 213	1,58
Australia 3.75% 14 - 21.04.37	839 000	AUD	1 043 852	1 135 964	2,67
Australia 4.25% 14 - 21.04.26	2 007 000	AUD	2 323 130	2 437 321	5,73
Australia 4.25% 14 - 21.04.26	270 000	AUD	298 676	327 891	0,77
Australia 4.50% 13 - 21.04.33	996 000	AUD	1 295 638	1 411 820	3,32
Australia 4.75% 11 - 21.04.27	2 089 000	AUD	2 517 699	2 667 193	6,27
Australia 5.50% 11 - 21.04.23	2 123 000	AUD	2 376 325	2 433 404	5,72
Australia 5.75% 10 - 15.07.22	1 420 000	AUD	1 552 409	1 578 046	3,71
Australia 5.75% 10 - 15.07.22	356 000	AUD	379 995	395 623	0,93
			40 344 002	42 282 025	99,43
Total - Obligations			40 344 002	42 282 025	99,43
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			40 344 002	42 282 025	99,43
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			40 344 002	42 282 025	99,43
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				42 493 970	99,92

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.31	3 400 000	EUR	3 382 893	3 423 120	2,95
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.32	1 700 000	EUR	1 672 634	1 696 192	1,46
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.45	2 600 000	EUR	2 177 024	2 229 474	1,92
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.48	2 300 000	EUR	1 855 424	1 919 465	1,65
France OAT Zero Coupon 14 - 25.11.24	1 000 000	EUR	1 017 390	1 023 910	0,88
France OAT Zero Coupon 16 - 25.05.49	1 400 000	EUR	1 081 905	1 156 526	1,00
France OAT Zero Coupon 16 - 25.05.51	1 200 000	EUR	892 749	984 144	0,85
France OAT Zero Coupon 16 - 25.05.52	1 200 000	EUR	876 510	980 100	0,84
			12 956 529	13 412 931	11,55
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 10 - 07.04.42	4 300 000	EUR	4 342 758	4 354 911	3,75
			4 342 758	4 354 911	3,75
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.21	3 400 000	EUR	3 402 841	3 398 912	2,93
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 98 - 11.01.29	8 200 000	EUR	7 114 094	7 230 678	6,22
			10 516 935	10 629 590	9,15
Total - Obligations			27 816 222	28 397 432	24,45
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			27 816 222	28 397 432	24,45
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.24	8 000 000	EUR	7 642 538	7 822 400	6,73
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.28	2 200 000	EUR	2 064 672	2 000 042	1,72
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.20	1 300 000	EUR	1 299 650	1 300 208	1,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.21	6 250 000	EUR	6 219 420	6 255 625	5,39
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.22	2 400 000	EUR	2 365 420	2 394 888	2,06
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.23	2 900 000	EUR	2 843 353	2 877 583	2,48
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.24	2 200 000	EUR	2 145 892	2 161 874	1,86
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.24	1 900 000	EUR	1 825 563	1 853 735	1,60

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.25	1 800 000	EUR	1 712 360	1 742 076	1,50
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.27	1 600 000	EUR	1 440 705	1 478 160	1,27
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.29	2 400 000	EUR	2 074 772	2 153 400	1,85
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 10 - 09.01.20	5 000 000	EUR	5 001 865	5 002 750	4,31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 10 - 03.01.23	1 200 000	EUR	1 177 631	1 189 020	1,02
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 10 - 09.01.23	1 700 000	EUR	1 656 754	1 673 786	1,44
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 10 - 03.01.24	1 100 000	EUR	1 061 146	1 076 801	0,93
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 12 - 09.01.22	790 000	EUR	767 299	787 867	0,68
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 09.01.20	6 200 000	EUR	6 199 992	6 200 062	5,34
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 03.01.21	6 400 000	EUR	6 398 182	6 405 120	5,51
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 09.01.21	5 300 000	EUR	5 297 919	5 304 664	4,57
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 09.01.22	1 700 000	EUR	1 698 887	1 694 135	1,46
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 09.01.23	400 000	EUR	379 119	394 556	0,34
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 03.01.25	600 000	EUR	585 937	579 492	0,50
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 09.01.25	4 700 000	EUR	4 552 603	4 501 895	3,88
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 03.01.26	4 200 000	EUR	3 978 029	3 962 910	3,41
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 03.01.27	2 200 000	EUR	2 029 186	2 052 578	1,77
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 09.01.30	4 100 000	EUR	3 364 153	3 477 087	2,99
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 14 - 12.01.24	10 300 000	EUR	9 921 110	10 046 414	8,65
			85 704 157	86 389 128	74,38
Total - Obligations			85 704 157	86 389 128	74,38
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			85 704 157	86 389 128	74,38
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			113 520 379	114 786 560	98,83
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				114 786 560	98,83

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Australie					
Commonwealth Bank of Australia 3.00% 12 - 05.03.22	400 000	EUR	437 480	424 286	4,76
Westpac Banking Corp. 0.75% 18 - 17.10.23	600 000	EUR	606 160	613 845	6,89
			1 043 640	1 038 131	11,65
Autriche					
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	100 000	EUR	173 195	197 103	2,21
			173 195	197 103	2,21
Belgique					
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.21	200 000	EUR	200 614	200 800	2,25
			200 614	200 800	2,25
Canada					
Bank of Montreal 2.35% 17 - 09.11.22	525 000	USD	457 713	488 338	5,48
Bank of Montreal FRN 17 - 15.12.32	100 000	USD	84 614	95 830	1,08
Royal Bank of Canada 1.625% 13 - 08.04.20	1 000 000	EUR	1 001 634	1 001 830	11,24
			1 543 961	1 585 998	17,80
France					
Credit Agricole Home Loan SFH SA 0.625% 14 - 28.11.22	100 000	EUR	101 198	102 310	1,15
Credit Mutuel Home Loan SFH SA 1.75% 14 - 19.06.24	400 000	EUR	425 416	432 984	4,86
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.31	100 000	EUR	90 935	100 680	1,13
Veolia Environnement SA 0.672% 17 - 30.03.22	700 000	EUR	708 124	704 213	7,90
			1 325 673	1 340 187	15,04
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 00 - 01.04.31	200 000	EUR	208 463	208 732	2,34
			208 463	208 732	2,34
Italie					
Intesa Sanpaolo SpA 2.00% 14 - 18.06.21	450 000	EUR	465 746	456 628	5,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 98 - 11.01.29	400 000	EUR	363 858	352 716	3,96
			829 604	809 344	9,08
Pays-Bas					
ING Bank NV 3.375% 12 - 01.10.22	600 000	EUR	659 604	634 120	7,12
ING Bank NV 3.625% 11 - 31.08.21	1 000 000	EUR	1 093 860	1 046 439	11,74
			1 753 464	1 680 559	18,86
Espagne					
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 01 - 30.07.21	100 000	EUR	100 366	100 460	1,13
			100 366	100 460	1,13
Supranationales					
European Investment Bank 1.50% 13 - 15.07.20	100 000	EUR	100 078	100 075	1,12
			100 078	100 075	1,12
Royaume-Uni					
Lloyds Banking Group PLC 4.65% 16 - 24.03.26	330 000	USD	292 322	326 763	3,67

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
National Westminster Bank PLC 3.875% 10 - 19.10.20	200 000	EUR	212 828	202 552	2,27
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 17 - 15.05.23	700 000	USD	610 286	647 058	7,26
			1 115 436	1 176 373	13,20
Total - Obligations			8 394 494	8 437 762	94,68
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			8 394 494	8 437 762	94,68
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.22	100 000	EUR	99 612	99 667	1,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 10 - 09.01.20	100 000	EUR	100 037	100 055	1,12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 15 - 06.01.25	100 000	EUR	94 899	96 731	1,08
			294 548	296 453	3,32
Total - Obligations			294 548	296 453	3,32
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			294 548	296 453	3,32
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			8 689 042	8 734 215	98,00
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				8 814 438	98,91

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Irlande					
Ireland Zero Coupon 17 - 18.10.22	4 541 000	EUR	4 592 023	4 596 054	0,90
Ireland 0.80% 15 - 15.03.22	6 144 000	EUR	6 270 026	6 283 817	1,24
Ireland 3.90% 13 - 20.03.23	6 195 000	EUR	6 919 191	6 944 296	1,36
			17 781 240	17 824 167	3,50
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.05% 19 - 15.01.23	13 873 000	EUR	13 850 937	13 828 361	2,72
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.35% 16 - 11.01.21	14 081 000	EUR	13 967 880	14 161 825	2,78
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.45% 16 - 06.01.21	13 990 000	EUR	13 944 028	14 062 422	2,77
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.90% 17 - 08.01.22	16 040 000	EUR	16 301 839	16 308 910	3,21
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 16 - 15.03.23	14 065 000	EUR	14 212 602	14 341 307	2,82
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 18 - 03.01.23	15 079 000	EUR	15 235 379	15 374 360	3,02
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	10 524 000	EUR	10 666 531	10 722 022	2,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.00% 19 - 15.07.22	1 620 000	EUR	1 650 517	1 650 482	0,32
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.20% 17 - 04.01.22	15 014 000	EUR	15 108 809	15 308 312	3,01
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 15 - 15.04.22	16 070 000	EUR	16 248 501	16 434 106	3,23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 15 - 15.09.22	15 470 000	EUR	15 948 692	15 917 357	3,13
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.15% 14 - 15.12.21	15 553 000	EUR	15 873 062	16 055 051	3,16
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.30% 18 - 15.10.21	14 088 000	EUR	14 326 223	14 522 455	2,86
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.75% 06 - 08.01.21	25 392 000	EUR	26 086 624	26 456 179	5,20
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 13 - 05.01.23	17 882 000	EUR	19 862 499	20 028 555	3,94
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 11 - 09.01.21	22 395 000	EUR	23 334 002	23 659 646	4,65
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 11 - 03.01.22	18 385 000	EUR	19 671 974	19 915 205	3,92
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.50% 12 - 09.01.22	17 328 000	EUR	19 394 698	19 344 674	3,80
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.50% 12 - 11.01.22	19 167 000	EUR	21 495 280	21 537 778	4,23
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 19 - 29.06.21	13 141 000	EUR	13 094 327	13 150 350	2,59
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 19 - 29.11.21	16 100 000	EUR	16 044 294	16 095 806	3,16
Italy Certificati di Credito Del Tesoro Zero Coupon 20 - 30.05.22	3 688 000	EUR	3 655 176	3 675 898	0,72
			339 973 874	342 551 061	67,35
Portugal					
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.20% 15 - 17.10.22	9 282 000	EUR	9 838 253	9 855 164	1,94
			9 838 253	9 855 164	1,94
Slovénie					
Slovenia 0.20% 20 - 31.03.23	1 761 000	EUR	1 771 831	1 782 326	0,35
			1 771 831	1 782 326	0,35
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 30.04.23	13 104 000	EUR	13 198 832	13 216 271	2,60
Spain 0.05% 18 - 31.10.21	18 736 000	EUR	18 816 017	18 857 883	3,71
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	17 295 000	EUR	17 524 549	17 554 444	3,45
Spain 0.40% 17 - 30.04.22	1 615 000	EUR	1 635 865	1 639 227	0,32
Spain 0.45% 17 - 31.10.22	16 717 000	EUR	17 012 558	17 044 235	3,35
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	12 499 000	EUR	12 624 633	12 664 237	2,49
Spain 0.75% 16 - 30.07.21	7 061 000	EUR	7 135 634	7 154 346	1,41

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain 5.40% 13 - 31.01.23	19 527 000	EUR	22 431 417	22 437 992	4,41
Spain 5.85% 11 - 31.01.22	20 324 000	EUR	22 275 194	22 353 961	4,40
			132 654 699	132 922 596	26,14
Total - Obligations			502 019 897	504 935 314	99,28
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			502 019 897	504 935 314	99,28
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			502 019 897	504 935 314	99,28
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				508 404 329	99,96

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Japon					
Japan Government Five Year Bond 0.10% 16 - 20.06.21	341 800 000	JPY	342 690 728	342 712 606	0,24
Japan Government Five Year Bond 0.10% 16 - 20.09.21	412 150 000	JPY	413 481 050	413 493 609	0,29
Japan Government Five Year Bond 0.10% 16 - 20.12.21	339 800 000	JPY	341 176 318	341 115 026	0,24
Japan Government Five Year Bond 0.10% 17 - 20.03.22	361 150 000	JPY	362 902 369	362 688 499	0,26
Japan Government Five Year Bond 0.10% 17 - 20.06.22	424 150 000	JPY	426 525 634	426 190 162	0,30
Japan Government Five Year Bond 0.10% 17 - 20.09.22	486 850 000	JPY	489 774 301	489 556 886	0,35
Japan Government Five Year Bond 0.10% 17 - 20.12.22	401 550 000	JPY	404 261 368	403 995 440	0,29
Japan Government Five Year Bond 0.10% 18 - 20.03.23	702 200 000	JPY	707 133 973	706 834 520	0,50
Japan Government Five Year Bond 0.10% 18 - 20.06.23	324 450 000	JPY	327 125 513	326 756 840	0,23
Japan Government Five Year Bond 0.10% 18 - 20.09.23	382 050 000	JPY	385 384 498	384 968 862	0,27
Japan Government Five Year Bond 0.10% 19 - 20.06.24	792 800 000	JPY	802 742 036	800 077 904	0,56
Japan Government Five Year Bond 0.10% 19 - 20.09.24	828 200 000	JPY	837 680 862	836 101 028	0,59
Japan Government Five Year Bond 0.10% 20 - 20.12.24	1 214 050 000	JPY	1 230 108 202	1 226 008 392	0,87
Japan Government Five Year Bond 0.10% 20 - 20.03.25	997 150 000	JPY	1 008 741 845	1 006 752 554	0,71
Japan Government Five Year Bond 0.10% 19 - 20.12.23	645 300 000	JPY	651 727 840	650 565 648	0,46
Japan Government Five Year Bond 0.10% 19 - 20.03.24	496 800 000	JPY	502 359 206	501 107 256	0,35
Japan Government Forty Year Bond 0.40% 16 - 20.03.56	660 350 000	JPY	634 344 740	616 106 550	0,43
Japan Government Forty Year Bond 0.50% 19 - 20.03.59	764 550 000	JPY	788 237 133	733 830 381	0,52
Japan Government Forty Year Bond 0.80% 18 - 20.03.58	720 450 000	JPY	791 391 168	765 715 873	0,54
Japan Government Forty Year Bond 0.90% 17 - 20.03.57	668 100 000	JPY	748 679 546	731 075 106	0,52
Japan Government Forty Year Bond 1.40% 15 - 20.03.55	320 200 000	JPY	418 063 289	399 929 800	0,28
Japan Government Forty Year Bond 1.70% 14 - 20.03.54	313 300 000	JPY	426 336 481	418 327 559	0,30
Japan Government Forty Year Bond 1.90% 13 - 20.03.53	304 800 000	JPY	435 927 327	422 355 264	0,30
Japan Government Forty Year Bond 2.00% 12 - 20.03.52	555 250 000	JPY	793 148 195	779 554 342	0,55

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Forty Year Bond 2.20% 09 - 20.03.49	373 500 000	JPY	545 791 723	533 925 720	0,38
Japan Government Forty Year Bond 2.20% 10 - 20.03.50	379 000 000	JPY	559 254 216	545 445 430	0,39
Japan Government Forty Year Bond 2.20% 11 - 20.03.51	557 800 000	JPY	831 660 814	808 313 558	0,57
Japan Government Forty Year Bond 2.40% 07 - 20.03.48	221 500 000	JPY	334 151 608	326 041 355	0,23
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.03.26	256 750 000	JPY	260 464 073	259 795 055	0,18
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.06.26	330 400 000	JPY	335 257 222	334 487 048	0,24
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.09.26	481 800 000	JPY	489 531 579	487 923 678	0,34
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.12.26	601 850 000	JPY	611 569 983	609 680 068	0,43
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 17 - 20.03.27	403 450 000	JPY	410 266 280	409 086 197	0,29
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 17 - 20.06.27	508 000 000	JPY	517 024 641	514 888 480	0,36
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 17 - 20.09.27	398 300 000	JPY	404 428 296	403 951 877	0,29
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 17 - 20.12.27	345 750 000	JPY	351 639 121	350 597 415	0,25
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 18 - 20.03.28	386 600 000	JPY	392 918 293	391 931 214	0,28
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 18 - 20.06.28	444 800 000	JPY	451 427 210	450 822 592	0,32
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 18 - 20.09.28	387 350 000	JPY	393 146 952	392 346 815	0,28
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 19 - 20.12.28	440 150 000	JPY	447 556 410	445 502 224	0,31
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 19 - 20.03.29	628 700 000	JPY	639 897 388	635 816 884	0,45
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 19 - 20.06.29	840 300 000	JPY	857 179 152	849 089 538	0,60
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 19 - 20.09.29	1 274 100 000	JPY	1 293 101 569	1 285 859 943	0,91
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 20 - 20.12.29	1 460 550 000	JPY	1 485 434 878	1 472 234 400	1,04
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 20 - 20.03.30	1 137 150 000	JPY	1 150 527 134	1 145 860 569	0,81
Japan Government Ten Year Bond 0.30% 15 - 20.12.24	249 150 000	JPY	254 902 369	253 843 986	0,18
Japan Government Ten Year Bond 0.30% 15 - 20.12.25	300 900 000	JPY	308 542 206	307 631 133	0,22
Japan Government Ten Year Bond 0.40% 15 - 20.03.25	371 750 000	JPY	381 403 118	380 619 955	0,27
Japan Government Ten Year Bond 0.40% 15 - 20.06.25	581 600 000	JPY	597 454 610	596 052 760	0,42
Japan Government Ten Year Bond 0.40% 15 - 20.09.25	308 350 000	JPY	317 552 216	316 555 194	0,22
Japan Government Ten Year Bond 0.50% 14 - 20.09.24	512 300 000	JPY	526 889 628	525 886 196	0,37
Japan Government Ten Year Bond 0.50% 14 - 20.12.24	166 000 000	JPY	170 959 497	170 619 780	0,12
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 13 - 20.03.23	1 375 600 000	JPY	1 404 831 984	1 403 442 144	0,99
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 13 - 20.09.23	193 950 000	JPY	198 679 804	198 569 889	0,14
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 13 - 20.12.23	1 255 850 000	JPY	1 289 425 337	1 287 999 760	0,91
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 14 - 20.03.24	492 650 000	JPY	506 643 963	506 123 977	0,36
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 14 - 20.06.24	507 800 000	JPY	522 883 399	522 592 214	0,37
Japan Government Ten Year Bond 0.70% 12 - 20.12.22	627 300 000	JPY	640 911 001	640 460 754	0,45
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 12 - 20.06.22	1 076 950 000	JPY	1 097 654 788	1 097 013 578	0,77
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 12 - 20.09.22	1 915 000 000	JPY	1 956 661 308	1 955 540 550	1,38
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 13 - 20.12.22	1 388 350 000	JPY	1 421 810 572	1 420 920 691	1,00
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 13 - 20.06.23	1 377 550 000	JPY	1 417 702 950	1 416 093 849	1,00
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 13 - 20.09.23	690 350 000	JPY	711 981 896	711 260 701	0,50
Japan Government Ten Year Bond 0.90% 12 - 20.03.22	458 600 000	JPY	466 950 897	466 873 144	0,33
Japan Government Ten Year Bond 0.90% 12 - 20.06.22	642 700 000	JPY	656 389 341	655 946 047	0,46
Japan Government Ten Year Bond 1.00% 11 - 20.09.21	1 176 050 000	JPY	1 192 913 297	1 192 843 994	0,84
Japan Government Ten Year Bond 1.00% 12 - 20.12.21	1 115 850 000	JPY	1 135 185 344	1 134 975 669	0,80
Japan Government Ten Year Bond 1.00% 12 - 20.03.22	1 240 250 000	JPY	1 265 363 065	1 264 757 340	0,89

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Ten Year Bond 1.10% 11 - 20.06.21	554 950 000	JPY	561 770 784	561 820 281	0,40
Japan Government Ten Year Bond 1.10% 11 - 20.09.21	566 900 000	JPY	575 636 039	575 692 619	0,41
Japan Government Ten Year Bond 1.10% 11 - 20.12.21	706 000 000	JPY	719 112 123	719 138 660	0,51
Japan Government Ten Year Bond 1.20% 11 - 20.06.21	762 900 000	JPY	772 992 924	773 084 715	0,55
Japan Government Thirty Year Bond 0.30% 16 - 20.06.46	428 250 000	JPY	411 755 978	404 833 290	0,29
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 19 - 20.06.49	653 050 000	JPY	663 105 575	622 748 480	0,44
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 19 - 20.09.49	677 950 000	JPY	680 165 017	645 489 754	0,46
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 20 - 20.12.49	673 200 000	JPY	673 564 404	639 977 580	0,45
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 20 - 20.03.50	474 350 000	JPY	464 923 050	450 215 072	0,32
Japan Government Thirty Year Bond 0.50% 16 - 20.09.46	581 200 000	JPY	586 953 711	577 207 156	0,41
Japan Government Thirty Year Bond 0.60% 16 - 20.12.46	417 050 000	JPY	430 636 669	423 864 597	0,30
Japan Government Thirty Year Bond 0.70% 18 - 20.06.48	676 800 000	JPY	717 633 387	701 685 936	0,50
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 16 - 20.03.46	456 850 000	JPY	498 003 133	487 486 361	0,34
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 17 - 20.03.47	344 150 000	JPY	376 906 843	365 948 461	0,26
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 17 - 20.06.47	389 350 000	JPY	419 853 820	414 237 252	0,29
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 17 - 20.09.47	443 000 000	JPY	473 972 271	471 573 500	0,33
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 17 - 20.12.47	500 050 000	JPY	543 753 977	531 953 190	0,38
Japan Government Thirty Year Bond 0.80% 18 - 20.03.48	702 000 000	JPY	763 103 717	746 247 060	0,53
Japan Government Thirty Year Bond 0.90% 18 - 20.09.48	492 750 000	JPY	548 076 186	535 116 645	0,38
Japan Government Thirty Year Bond 1.10% 03 - 20.03.33	139 000 000	JPY	156 398 557	155 378 370	0,11
Japan Government Thirty Year Bond 1.40% 15 - 20.09.45	207 450 000	JPY	257 760 697	250 910 775	0,18
Japan Government Thirty Year Bond 1.40% 15 - 20.12.45	324 300 000	JPY	400 626 060	392 415 972	0,28
Japan Government Thirty Year Bond 1.50% 14 - 20.12.44	295 000 000	JPY	370 751 557	362 767 400	0,26
Japan Government Thirty Year Bond 1.50% 15 - 20.03.45	499 700 000	JPY	622 431 886	614 870 856	0,43
Japan Government Thirty Year Bond 1.60% 15 - 20.06.45	240 500 000	JPY	308 402 531	301 841 930	0,21
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 03 - 20.06.33	205 400 000	JPY	246 167 350	245 695 372	0,17

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 13 - 20.12.43	438 950 000	JPY	563 989 510	557 519 174	0,39
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 14 - 20.03.44	527 450 000	JPY	684 331 691	670 584 106	0,47
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 14 - 20.06.44	349 750 000	JPY	454 392 887	445 123 328	0,31
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 14 - 20.09.44	399 200 000	JPY	516 649 175	508 560 840	0,36
Japan Government Thirty Year Bond 1.80% 02 - 22.11.32	150 850 000	JPY	181 433 929	181 366 955	0,13
Japan Government Thirty Year Bond 1.80% 13 - 20.03.43	630 200 000	JPY	819 527 516	811 741 714	0,57
Japan Government Thirty Year Bond 1.80% 13 - 20.09.43	395 200 000	JPY	519 564 208	510 305 952	0,36
Japan Government Thirty Year Bond 1.90% 12 - 20.09.42	1 135 400 000	JPY	1 497 479 715	1 481 890 018	1,05
Japan Government Thirty Year Bond 1.90% 13 - 20.06.43	505 750 000	JPY	673 877 854	662 851 122	0,47
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 04 - 20.12.33	204 700 000	JPY	254 479 335	253 692 898	0,18
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 10 - 20.09.40	964 950 000	JPY	1 274 878 828	1 259 626 431	0,89
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 11 - 20.09.41	964 100 000	JPY	1 283 843 877	1 269 729 341	0,90
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 12 - 20.03.42	910 800 000	JPY	1 219 622 898	1 203 449 148	0,85
Japan Government Thirty Year Bond 2.10% 03 - 20.09.33	180 000 000	JPY	227 198 326	224 967 600	0,16
Japan Government Thirty Year Bond 2.20% 09 - 20.09.39	689 800 000	JPY	929 984 404	919 993 158	0,65
Japan Government Thirty Year Bond 2.20% 11 - 20.03.41	853 600 000	JPY	1 167 537 300	1 153 111 168	0,81
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 02 - 20.05.32	199 900 000	JPY	252 571 352	251 086 394	0,18
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 05 - 20.03.35	344 450 000	JPY	449 969 696	446 655 204	0,32
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 05 - 20.06.35	262 850 000	JPY	343 148 820	341 557 804	0,24
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 06 - 20.12.35	297 200 000	JPY	391 070 997	388 175 892	0,27
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 07 - 20.12.36	281 700 000	JPY	375 149 456	371 525 679	0,26
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 09 - 20.03.39	733 500 000	JPY	1 005 338 096	985 963 365	0,70
Japan Government Thirty Year Bond 2.30% 10 - 20.03.40	855 300 000	JPY	1 173 406 851	1 160 188 791	0,82
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 01 - 20.11.31	153 000 000	JPY	193 570 379	192 793 770	0,14

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 04 - 20.03.34	285 900 000	JPY	372 859 188	370 763 697	0,26
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 05 - 20.12.34	273 000 000	JPY	359 437 984	357 108 570	0,25
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 07 - 20.03.37	537 050 000	JPY	722 551 440	718 465 490	0,51
Japan Government Thirty Year Bond 2.40% 08 - 20.09.38	714 600 000	JPY	978 101 005	969 169 104	0,68
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 04 - 20.06.34	363 050 000	JPY	480 086 888	476 938 785	0,34
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 04 - 20.09.34	232 950 000	JPY	310 404 173	306 809 127	0,22
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 05 - 20.09.35	256 550 000	JPY	344 484 978	341 765 648	0,24
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 06 - 20.03.36	358 250 000	JPY	481 231 286	479 893 788	0,34
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 06 - 20.06.36	330 400 000	JPY	443 130 642	444 497 032	0,31
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 06 - 20.09.36	210 700 000	JPY	284 575 876	283 781 295	0,20
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 07 - 20.09.37	518 650 000	JPY	713 038 206	705 670 003	0,50
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 08 - 20.03.38	659 600 000	JPY	909 861 010	901 712 776	0,64
Japan Government Thirty Year Bond 0.50% 19 - 20.03.49	670 300 000	JPY	686 363 274	657 470 458	0,46
Japan Government Thirty Year Bond 0.70% 19 - 20.12.48	593 050 000	JPY	635 585 649	613 006 132	0,43
Japan Government Twenty Year Bond 0.20% 16 - 20.06.36	589 750 000	JPY	589 566 540	581 564 270	0,41
Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 19 - 20.06.39	862 950 000	JPY	876 684 593	847 675 785	0,60
Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 19 - 20.09.39	866 500 000	JPY	873 643 341	851 362 245	0,60
Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 20 - 20.12.39	907 500 000	JPY	915 123 025	890 257 500	0,63
Japan Government Twenty Year Bond 0.40% 16 - 20.03.36	384 000 000	JPY	392 177 940	390 723 840	0,28
Japan Government Twenty Year Bond 0.40% 20 - 20.03.40	591 350 000	JPY	599 402 125	589 966 241	0,42
Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 16 - 20.09.36	485 200 000	JPY	501 416 789	500 313 980	0,35
Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 18 - 20.03.38	727 100 000	JPY	749 915 907	744 884 866	0,53
Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 18 - 20.06.38	800 350 000	JPY	822 104 265	819 174 232	0,58
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 16 - 20.12.36	662 500 000	JPY	698 429 590	693 041 250	0,49

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 17 - 20.06.37	543 850 000	JPY	571 764 543	568 274 303	0,40
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 17 - 20.09.37	661 100 000	JPY	694 018 671	690 347 064	0,49
Japan Government Twenty Year Bond 0.60% 17 - 20.12.37	567 950 000	JPY	594 986 130	592 718 299	0,42
Japan Government Twenty Year Bond 0.70% 17 - 20.03.37	550 300 000	JPY	588 165 194	584 077 414	0,41
Japan Government Twenty Year Bond 0.70% 18 - 20.09.38	745 950 000	JPY	796 430 675	789 573 156	0,56
Japan Government Twenty Year Bond 0.80% 03 - 20.06.23	187 050 000	JPY	192 431 492	192 283 659	0,14
Japan Government Twenty Year Bond 1.00% 03 - 20.03.23	165 150 000	JPY	170 399 942	170 296 074	0,12
Japan Government Twenty Year Bond 1.00% 15 - 20.12.35	750 800 000	JPY	841 657 092	833 921 068	0,59
Japan Government Twenty Year Bond 1.20% 14 - 20.12.34	657 050 000	JPY	751 459 274	747 650 624	0,53
Japan Government Twenty Year Bond 1.20% 15 - 20.03.35	723 350 000	JPY	827 904 150	823 360 371	0,58
Japan Government Twenty Year Bond 1.20% 15 - 20.09.35	501 050 000	JPY	576 456 561	570 961 506	0,40
Japan Government Twenty Year Bond 1.30% 15 - 20.06.35	557 500 000	JPY	646 377 627	642 830 950	0,45
Japan Government Twenty Year Bond 1.40% 03 - 20.12.22	153 150 000	JPY	159 163 695	159 021 771	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 1.40% 14 - 20.09.34	896 150 000	JPY	1 051 014 847	1 042 634 679	0,74
Japan Government Twenty Year Bond 1.50% 12 - 20.06.32	348 950 000	JPY	407 387 078	405 783 487	0,29
Japan Government Twenty Year Bond 1.50% 13 - 20.03.33	381 300 000	JPY	447 751 525	445 804 521	0,31
Japan Government Twenty Year Bond 1.50% 14 - 20.03.34	577 950 000	JPY	682 441 104	678 981 439	0,48
Japan Government Twenty Year Bond 1.50% 14 - 20.06.34	684 300 000	JPY	810 689 459	804 791 544	0,57
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 10 - 20.06.30	389 250 000	JPY	450 703 576	449 708 310	0,32
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 12 - 20.03.32	294 500 000	JPY	345 773 221	345 333 645	0,24
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 12 - 20.06.32	278 950 000	JPY	330 596 602	327 674 197	0,23
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 13 - 20.03.33	520 550 000	JPY	618 770 141	615 113 113	0,43
Japan Government Twenty Year Bond 1.60% 13 - 20.12.33	644 800 000	JPY	767 759 872	765 203 504	0,54
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 02 - 20.12.22	204 650 000	JPY	214 109 333	214 018 877	0,15

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 11 - 20.09.31	301 300 000	JPY	355 275 435	355 401 428	0,25
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 11 - 20.12.31	436 450 000	JPY	517 300 710	515 857 713	0,36
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 12 - 20.03.32	236 300 000	JPY	281 287 584	279 824 097	0,20
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 12 - 20.06.32	298 950 000	JPY	355 678 214	354 695 207	0,25
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 12 - 20.09.32	852 050 000	JPY	1 017 782 466	1 012 763 671	0,72
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 12 - 20.12.32	666 000 000	JPY	798 845 523	793 039 500	0,56
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 13 - 20.06.33	662 800 000	JPY	797 633 511	792 828 104	0,56
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 13 - 20.09.33	644 000 000	JPY	774 023 581	771 569 960	0,54
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 03 - 20.06.23	245 400 000	JPY	259 745 780	259 584 120	0,18
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 10 - 20.06.30	351 000 000	JPY	414 164 085	412 491 690	0,29
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 10 - 20.09.30	371 100 000	JPY	439 608 578	437 259 708	0,31
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 11 - 20.06.31	307 000 000	JPY	365 234 218	364 313 830	0,26
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 11 - 20.09.31	621 450 000	JPY	741 264 919	739 941 871	0,52
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 12 - 20.12.31	561 200 000	JPY	669 220 375	669 668 736	0,47
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 12 - 20.03.32	471 350 000	JPY	563 496 487	563 621 476	0,40
Japan Government Twenty Year Bond 1.80% 13 - 20.12.32	357 500 000	JPY	431 519 896	430 072 500	0,30
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 02 - 20.06.22	180 500 000	JPY	187 984 308	187 784 980	0,13
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 02 - 20.09.22	172 700 000	JPY	180 755 004	180 590 663	0,13
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 03 - 20.09.23	223 250 000	JPY	238 082 226	237 959 943	0,17
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 03 - 20.12.23	184 100 000	JPY	197 385 476	197 091 937	0,14
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 04 - 20.03.24	185 300 000	JPY	199 505 327	199 293 856	0,14
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 05 - 20.03.25	233 450 000	JPY	256 396 047	255 620 747	0,18
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 05 - 20.06.25	195 400 000	JPY	215 808 893	214 893 104	0,15
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 09 - 20.12.28	366 750 000	JPY	428 575 241	426 974 018	0,30

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 09 - 20.03.29	422 650 000	JPY	494 656 835	493 498 820	0,35
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 10 - 20.09.30	432 250 000	JPY	514 668 940	513 707 512	0,36
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 11 - 20.03.31	322 100 000	JPY	385 174 992	384 764 555	0,27
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 11 - 20.06.31	585 750 000	JPY	704 591 636	701 470 770	0,50
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 01 - 21.06.21	146 650 000	JPY	149 762 343	149 757 514	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 02 - 21.03.22	254 550 000	JPY	264 042 066	263 981 078	0,19
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 02 - 20.06.22	165 200 000	JPY	172 221 119	172 194 568	0,12
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 04 - 20.12.24	355 700 000	JPY	389 826 330	389 583 982	0,27
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 05 - 20.09.25	215 250 000	JPY	239 409 295	238 936 110	0,17
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 06 - 20.12.25	319 000 000	JPY	356 774 165	355 978 480	0,25
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 07 - 20.03.27	261 350 000	JPY	299 107 506	298 396 363	0,21
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 10 - 20.06.30	339 900 000	JPY	408 081 742	406 200 894	0,29
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 11 - 20.12.30	361 200 000	JPY	434 801 445	434 155 176	0,31
Japan Government Twenty Year Bond 2.00% 11 - 20.03.31	417 400 000	JPY	502 963 508	503 046 306	0,36
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 01 - 20.12.21	226 600 000	JPY	234 215 842	234 125 386	0,17
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 04 - 20.03.24	296 450 000	JPY	321 502 900	321 052 386	0,23
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 04 - 20.09.24	426 450 000	JPY	467 218 607	466 719 674	0,33
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 05 - 20.03.25	142 400 000	JPY	157 659 506	157 273 680	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 05 - 20.09.25	202 700 000	JPY	226 907 710	226 069 283	0,16
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 05 - 20.12.25	195 150 000	JPY	219 123 018	218 847 065	0,15
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 06 - 20.03.26	279 100 000	JPY	315 459 215	314 523 372	0,22
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 06 - 20.12.26	497 650 000	JPY	570 799 798	568 953 292	0,40
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 07 - 20.03.27	420 700 000	JPY	484 455 117	483 182 364	0,34
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 07 - 20.06.27	175 000 000	JPY	202 025 648	201 927 250	0,14

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 07 - 20.09.27	219 650 000	JPY	255 124 852	254 526 027	0,18
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 07 - 20.12.27	632 150 000	JPY	736 879 233	735 531 811	0,52
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 08 - 20.06.28	210 450 000	JPY	247 471 677	246 832 596	0,17
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 08 - 20.09.28	459 950 000	JPY	541 873 512	541 420 943	0,38
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 08 - 20.12.28	216 000 000	JPY	255 582 581	255 139 200	0,18
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 09 - 20.03.29	451 700 000	JPY	537 278 574	535 305 153	0,38
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 09 - 20.06.29	495 050 000	JPY	590 335 755	589 173 856	0,42
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 09 - 20.09.29	477 100 000	JPY	571 722 338	569 499 957	0,40
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 09 - 20.12.29	483 950 000	JPY	582 162 599	579 360 742	0,41
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 10 - 20.03.30	682 650 000	JPY	822 615 196	820 285 893	0,58
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 10 - 20.12.30	671 900 000	JPY	817 022 695	814 598 122	0,58
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 02 - 20.12.21	176 250 000	JPY	182 536 477	182 362 350	0,13
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 04 - 20.03.24	148 150 000	JPY	161 326 615	160 997 568	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 04 - 20.06.24	134 250 000	JPY	146 897 168	146 732 565	0,10
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 06 - 20.03.26	184 750 000	JPY	210 180 151	209 260 783	0,15
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 06 - 20.06.26	163 650 000	JPY	186 867 308	186 322 071	0,13
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 06 - 20.09.26	365 050 000	JPY	419 054 529	417 431 025	0,29
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 07 - 20.09.27	303 800 000	JPY	356 155 301	354 245 990	0,25
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 08 - 20.03.28	506 950 000	JPY	597 170 139	596 137 713	0,42
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 08 - 20.09.28	216 950 000	JPY	257 551 052	257 168 191	0,18
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 09 - 20.06.29	260 300 000	JPY	312 849 591	312 128 333	0,22
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 10 - 20.12.29	282 100 000	JPY	341 812 595	340 384 681	0,24
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 10 - 20.03.30	374 150 000	JPY	454 905 140	453 215 378	0,32
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 11 - 20.03.31	412 650 000	JPY	508 698 943	506 098 719	0,36

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 06 - 20.03.26	198 500 000	JPY	226 799 909	225 976 370	0,16
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 06 - 20.06.26	330 000 000	JPY	378 535 107	377 701 500	0,27
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 06 - 20.09.26	140 650 000	JPY	162 350 988	161 712 338	0,11
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 07 - 20.06.27	273 050 000	JPY	320 028 335	318 895 095	0,23
Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 08 - 20.06.28	277 550 000	JPY	330 263 240	329 976 420	0,23
Japan Government Twenty Year Bond 2.40% 04 - 20.06.24	358 100 000	JPY	394 744 790	394 253 776	0,28
Japan Government Twenty Year Bond 2.40% 08 - 20.03.28	216 350 000	JPY	259 093 220	257 768 044	0,18
Japan Government Twenty Year Bond 2.40% 08 - 20.06.28	373 300 000	JPY	447 143 280	446 802 770	0,32
Japan Government Twenty Year Bond 0.40% 19 - 20.03.39	855 150 000	JPY	873 504 246	857 672 692	0,61
Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 19 - 20.12.38	842 900 000	JPY	876 919 935	861 030 779	0,61
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 06.01.21	215 150 000	JPY	215 727 602	215 769 632	0,15
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 07.01.21	406 650 000	JPY	407 815 563	407 833 352	0,29
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 08.01.21	457 650 000	JPY	459 251 003	458 986 338	0,32
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 09.01.21	492 100 000	JPY	494 029 287	493 645 194	0,35
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 10.01.21	545 250 000	JPY	547 236 090	547 071 135	0,39
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 11.01.21	498 100 000	JPY	499 957 972	499 863 274	0,35
Japan Government Two Year Bond 0.10% 19 - 12.01.21	368 050 000	JPY	369 387 599	369 426 507	0,26
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 01.01.22	368 700 000	JPY	370 173 799	370 152 678	0,26
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 02.01.22	521 200 000	JPY	524 014 654	523 357 768	0,37
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 03.01.22	505 000 000	JPY	507 462 323	507 181 600	0,36

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 04.01.22	339 900 000	JPY	341 621 669	341 432 949	0,24
Japan Government Two Year Bond 0.10% 20 - 05.01.22	440 000 000	JPY	442 197 157	442 068 000	0,31
			142 196 082 574	141 011 310 914	99,60
Total - Obligations			142 196 082 574	141 011 310 914	99,60
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			142 196 082 574	141 011 310 914	99,60
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			142 196 082 574	141 011 310 914	99,60
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				141 272 153 739	99,78

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Australie					
Australia 2.25% 16 - 21.05.28	24 000 000	AUD	17 134 899	18 423 432	2,09
Australia 2.50% 10 - 20.09.30	832 000	AUD	850 352	887 958	0,10
Australia 3.25% 15 - 21.06.39	10 500 000	AUD	8 639 526	9 214 618	1,05
Treasury Corp. of Victoria 2.50% 19 - 22.10.29	11 000 000	AUD	7 617 193	8 407 871	0,95
			34 241 970	36 933 879	4,19
Autriche					
Austria Zero Coupon 97 - 15.07.27	3 715 000	EUR	4 200 535	4 279 777	0,49
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	4 200 000	EUR	8 649 331	9 297 798	1,05
			12 849 866	13 577 575	1,54
Belgique					
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.22	2 300 000	EUR	2 579 025	2 611 532	0,30
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.23	2 200 000	EUR	2 488 460	2 509 501	0,28
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.24	1 000 000	EUR	1 131 843	1 144 490	0,13
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.25	1 000 000	EUR	1 123 470	1 147 331	0,13
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.26	2 000 000	EUR	2 259 358	2 297 516	0,26
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.28	4 600 000	EUR	5 021 240	5 271 525	0,60
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 19 - 14.01.26	300 000	EUR	353 983	354 316	0,04
			14 957 379	15 336 211	1,74
Canada					
Province of Quebec Canada 0.75% 14 - 21.11.24	10 000 000	CHF	10 668 536	11 017 149	1,25
			10 668 536	11 017 149	1,25
Danemark					
Danske Bank A/S FRN 19 - 21.06.29	1 100 000	EUR	1 273 649	1 261 779	0,15
ISS Global A/S 2.125% 14 - 12.02.24	1 000 000	EUR	1 175 008	1 166 195	0,13
			2 448 657	2 427 974	0,28
Finlande					
Fortum OYJ 2.125% 19 - 27.02.29	700 000	EUR	845 821	853 644	0,10
			845 821	853 644	0,10
France					
Aéroports de Paris 2.75% 13 - 06.05.28	400 000	EUR	539 719	510 263	0,06
APRR SA 1.125% 14 - 15.01.21	300 000	EUR	334 522	337 787	0,04
APRR SA 1.125% 16 - 01.09.26	100 000	EUR	116 786	116 898	0,01
Arkema SA 1.50% 15 - 20.01.25	900 000	EUR	1 044 070	1 055 318	0,12
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.50% 18 - 25.05.28	400 000	EUR	447 982	482 691	0,05
BNP Paribas SA 0.75% 16 - 11.11.22	1 300 000	EUR	1 469 523	1 483 221	0,17
BNP Paribas SA FRN 19 - 23.01.27	700 000	EUR	847 753	840 274	0,10
BNP Paribas SA 5.00% 11 - 15.01.21	899 000	USD	908 252	920 722	0,10
Bouygues SA 1.375% 16 - 06.07.27	400 000	EUR	481 103	478 852	0,05
BPCE SA 1.125% 17 - 18.01.23	1 300 000	EUR	1 471 916	1 478 692	0,17
BPCE SA FRN 15 - 30.11.27	600 000	EUR	709 034	700 154	0,08
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 3.60% 12 - 03.08.24	2 000 000	EUR	2 569 264	2 574 328	0,29
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 3.90% 11 - 18.01.21	1 800 000	EUR	2 008 247	2 069 220	0,24
Caisse Francaise de Financement Local 5.50% 01 - 16.07.26	6 217 000	GBP	10 352 057	9 871 355	1,12
Carrefour SA 1.75% 14 - 15.07.22	600 000	EUR	701 498	690 625	0,08

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Cie de Financement Foncier SA 2.00% 14 - 05.07.24	800 000	EUR	994 408	978 394	0,11
Cie de Financement Foncier SA 5.50% 01 - 26.01.27	1 600 000	GBP	2 709 699	2 575 274	0,29
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 0.375% 16 - 02.07.25	1 000 000	EUR	1 127 450	1 132 842	0,13
Credit Agricole Home Loan SFH SA 0.625% 14 - 28.11.22	900 000	EUR	1 029 519	1 034 189	0,12
Credit Agricole SA 0.75% 16 - 12.01.22	1 100 000	EUR	1 245 221	1 258 671	0,14
Credit Agricole SA 1.00% 17 - 16.09.24	1 500 000	EUR	1 663 086	1 751 660	0,20
Credit Agricole SA 3.125% 14 - 02.05.26	1 000 000	EUR	1 285 965	1 310 851	0,15
Credit Mutuel Arkea SA 1.25% 17 - 31.05.24	1 000 000	EUR	1 145 834	1 145 069	0,13
Dexia Credit Local SA 1.125% 17 - 15.06.22	2 400 000	GBP	3 166 388	3 009 023	0,34
Dexia Credit Local SA 1.375% 19 - 12.07.22	4 500 000	GBP	5 970 355	5 696 062	0,65
Dexia Credit Local SA 2.125% 15 - 02.12.25	40 100 000	GBP	55 111 672	52 693 857	5,98
EssilorLuxottica SA 1.75% 14 - 04.09.21	1 800 000	EUR	2 018 329	2 038 955	0,23
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.32	10 100 000	EUR	11 290 795	11 318 405	1,28
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.34	800 000	EUR	885 697	876 938	0,10
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.35	29 700 000	EUR	32 504 546	32 512 609	3,69
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.42	9 800 000	EUR	9 781 616	9 788 850	1,11
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.45	18 800 000	EUR	18 088 429	18 106 091	2,05
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.46	22 000 000	EUR	20 901 437	21 016 496	2,39
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.47	22 100 000	EUR	20 808 123	20 924 126	2,37
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.48	10 900 000	EUR	10 272 201	10 216 841	1,16
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.51	10 900 000	EUR	9 936 132	9 872 954	1,12
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.52	10 000 000	EUR	8 979 727	8 889 957	1,01
France OAT Zero Coupon 16 - 25.05.49	1 400 000	EUR	1 313 242	1 298 952	0,15
Icade 1.75% 16 - 06.10.26	400 000	EUR	479 461	455 352	0,05
Indigo Group SAS 2.125% 14 - 16.04.25	200 000	EUR	244 709	230 288	0,03
Orange SA 0.75% 17 - 09.11.23	1 500 000	EUR	1 731 819	1 711 420	0,19
Orange SA 3.125% 13 - 01.09.24	1 100 000	EUR	1 397 075	1 359 408	0,15
Orange SA 4.125% 11 - 14.09.21	1 000 000	USD	1 026 500	1 044 888	0,12
Publicis Groupe SA 0.50% 16 - 11.03.23	3 600 000	EUR	3 965 117	4 015 201	0,46
Sanofi 1.375% 18 - 21.03.30	200 000	EUR	250 527	247 644	0,03
Schneider Electric SE 1.50% 15 - 09.08.23	800 000	EUR	928 702	936 300	0,11
Societe Generale SA 1.25% 19 - 15.02.24	700 000	EUR	803 150	795 693	0,09
Total Capital International SA 2.50% 14 - 25.03.26	500 000	EUR	646 496	630 891	0,07
TOTAL SA FRN 15 - 29.12.49	1 400 000	EUR	1 679 412	1 602 899	0,18
Valeo SA 0.375% 17 - 09.12.22	500 000	EUR	557 621	543 139	0,06
Veolia Environnement SA 1.496% 17 - 30.11.26	700 000	EUR	828 737	840 014	0,10
			260 770 923	257 470 603	29,22
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 01.04.23	1 000 000	EUR	1 115 837	1 141 761	0,13
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 07.04.27	1 200 000	EUR	1 397 478	1 395 734	0,16
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 98 - 01.04.26	2 000 000	EUR	2 275 932	2 325 257	0,26
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 05 - 01.04.34	2 700 000	EUR	3 038 570	3 152 683	0,36

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 14 - 15.08.29	500 000	EUR	572 689	585 436	0,07
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 14 - 15.08.33	1 400 000	EUR	1 594 373	1 636 785	0,18
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 08 - 07.04.40	11 300 000	EUR	13 103 780	13 048 610	1,48
Commerzbank AG 0.625% 19 - 28.08.24	1 955 000	EUR	2 091 746	2 194 378	0,25
Deutsche Bahn Finance GMBH 0.75% 20 - 16.07.35	1 000 000	EUR	1 121 689	1 118 676	0,13
DZ HYP AG 3.65% 05 - 28.12.20	1 900 000	EUR	2 262 837	2 174 659	0,25
Evonik Industries AG 1.00% 15 - 23.01.23	600 000	EUR	685 098	686 449	0,08
Evonik Industries AG FRN 17 - 07.07.77	1 924 000	EUR	2 039 638	2 121 804	0,24
METRO AG 1.50% 15 - 19.03.25	600 000	EUR	678 118	660 938	0,07
SAP SE 1.25% 18 - 03.10.28	700 000	EUR	838 184	845 316	0,09
Talanx AG 2.50% 14 - 23.07.26	1 500 000	EUR	1 902 230	1 907 624	0,22
Volkswagen Bank GmbH 1.25% 19 - 08.01.22	1 100 000	EUR	1 243 790	1 239 893	0,14
Volkswagen Financial Services AG 2.25% 19 - 10.01.27	1 126 000	EUR	1 253 048	1 329 318	0,15
Volkswagen Leasing GmbH 0.25% 18 - 16.02.21	1 500 000	EUR	1 661 336	1 682 855	0,19
			38 876 373	39 248 176	4,45
Guernesey					
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1.25% 15 - 14.04.22	1 000 000	EUR	1 144 178	1 141 262	0,13
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3.80% 16 - 15.09.22	550 000	USD	574 899	584 357	0,07
			1 719 077	1 725 619	0,20
Irlande					
AIB Group PLC 1.25% 19 - 28.05.24	180 000	EUR	204 042	201 710	0,02
			204 042	201 710	0,02
Île de Man					
Isle of Man Government International Bond 5.625% 00 - 29.03.30	2 000 000	GBP	3 607 891	3 498 480	0,40
			3 607 891	3 498 480	0,40
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.21	1 900 000	EUR	2 113 508	2 133 302	0,24
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 09 - 09.01.40	6 500 000	EUR	9 956 031	10 962 973	1,25
UniCredit SpA 6.572% 19 - 14.01.22	1 000 000	USD	1 069 560	1 056 980	0,12
			13 139 099	14 153 255	1,61
Japon					
Asahi Group Holdings Ltd. 0.321% 17 - 19.09.21	220 000	EUR	244 851	245 895	0,03
Japan Government Five Year Bond 0.10% 15 - 20.12.20	1 300 000 000	JPY	12 051 471	12 064 810	1,37
Japan Government Forty Year Bond 1.90% 13 - 20.03.53	10 000 000	JPY	126 798	128 244	0,01
Japan Government Forty Year Bond 2.00% 12 - 20.03.52	25 300 000	JPY	326 004	328 904	0,04
Japan Government Forty Year Bond 2.20% 11 - 20.03.51	150 000 000	JPY	1 970 630	2 016 244	0,23

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Ten Year Bond 0.10% 16 - 20.06.26	1 000 000 000	JPY	9 301 569	9 385 271	1,06
Japan Government Ten Year Bond 0.30% 15 - 20.12.24	1 900 000 000	JPY	17 997 685	17 939 797	2,04
Japan Government Ten Year Bond 0.30% 15 - 20.12.25	650 000 000	JPY	6 183 124	6 160 917	0,70
Japan Government Ten Year Bond 0.40% 15 - 20.03.25	350 000 000	JPY	3 338 285	3 321 861	0,38
Japan Government Ten Year Bond 0.60% 13 - 20.09.23	500 000 000	JPY	4 775 344	4 744 821	0,54
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 12 - 20.09.22	1 007 850 000	JPY	9 623 522	9 538 725	1,08
Japan Government Ten Year Bond 0.80% 13 - 20.06.23	1 002 600 000	JPY	9 640 256	9 552 510	1,08
Japan Government Ten Year Bond 1.00% 10 - 20.09.20	602 600 000	JPY	5 666 252	5 599 932	0,63
Japan Government Ten Year Bond 1.00% 11 - 20.09.21	90 450 000	JPY	860 147	850 357	0,10
Japan Government Ten Year Bond 1.30% 11 - 20.03.21	600 000 000	JPY	5 709 602	5 620 151	0,64
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 19 - 20.06.49	200 000 000	JPY	1 881 664	1 769 792	0,20
Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 20 - 20.12.49	600 000 000	JPY	5 348 284	5 294 805	0,60
Japan Government Thirty Year Bond 1.40% 15 - 20.09.45	100 000 000	JPY	1 093 654	1 119 905	0,13
Japan Government Thirty Year Bond 1.50% 15 - 20.03.45	332 000 000	JPY	3 704 888	3 787 634	0,43
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 03 - 20.06.33	106 600 000	JPY	1 186 799	1 179 828	0,13
Japan Government Thirty Year Bond 1.70% 13 - 20.12.43	370 000 000	JPY	4 276 894	4 358 136	0,49
Japan Government Thirty Year Bond 1.80% 13 - 20.09.43	200 000 000	JPY	2 354 174	2 393 808	0,27
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 11 - 20.09.41	440 000 000	JPY	5 310 481	5 370 622	0,61
Japan Government Thirty Year Bond 2.00% 12 - 20.03.42	62 050 000	JPY	734 273	760 066	0,09
Japan Government Thirty Year Bond 2.50% 07 - 20.09.37	8 100 000	JPY	102 188	102 129	0,01
Japan Government Thirty Year Bond 2.80% 99 - 20.09.29	96 500 000	JPY	1 147 950	1 124 395	0,13
Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 19 - 20.06.39	200 000 000	JPY	1 889 542	1 820 698	0,21
Japan Government Twenty Year Bond 1.20% 14 - 20.12.34	1 220 000 000	JPY	12 506 226	12 847 855	1,46
Japan Government Twenty Year Bond 1.30% 15 - 20.06.35	500 000 000	JPY	5 322 157	5 336 747	0,60
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 13 - 20.06.33	83 550 000	JPY	930 279	924 669	0,10
Japan Government Twenty Year Bond 1.70% 13 - 20.09.33	220 000 000	JPY	2 452 388	2 441 096	0,28
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 04 - 20.03.24	142 100 000	JPY	1 450 584	1 416 574	0,16
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 10 - 20.09.30	392 150 000	JPY	4 341 591	4 318 757	0,49
Japan Government Twenty Year Bond 1.90% 11 - 20.03.31	300 000 000	JPY	3 358 362	3 321 871	0,38

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
Japan Government Twenty Year Bond 2.20% 08 - 20.09.28	275 000 000	JPY	3 077 002	3 023 075	0,34
Japan Government Twenty Year Bond 2.10% 01 - 22.03.21	121 850 000	JPY	1 179 408	1 148 045	0,13
			151 464 328	151 358 946	17,17
Jersey					
Glencore Finance Europe Ltd. 1.25% 15 - 17.03.21	200 000	EUR	229 857	224 515	0,03
			229 857	224 515	0,03
Luxembourg					
Allergan Funding SCS 2.625% 18 - 15.11.28	950 000	EUR	1 194 632	1 179 688	0,13
Aroundtown SA 1.50% 16 - 15.07.24	100 000	EUR	115 236	114 046	0,01
Aroundtown SA 2.00% 18 - 11.02.26	800 000	EUR	941 067	940 861	0,11
			2 250 935	2 234 595	0,25
Pays-Bas					
ABN AMRO Bank NV 4.125% 12 - 28.03.22	850 000	EUR	1 033 693	1 022 471	0,12
Aegon NV 1.00% 16 - 12.08.23	200 000	EUR	229 042	228 097	0,03
Allianz Finance II BV 3.00% 13 - 13.03.28	1 100 000	EUR	1 445 054	1 515 218	0,17
ASML Holding NV 1.375% 16 - 07.07.26	530 000	EUR	627 897	636 137	0,07
BMW Finance NV 0.125% 18 - 29.11.21	1 470 000	EUR	1 576 134	1 652 770	0,19
BMW Finance NV 0.625% 19 - 10.06.23	1 700 000	EUR	1 915 784	1 927 022	0,22
Coca-Cola HBC Finance BV 1.875% 16 - 11.11.24	1 000 000	EUR	1 189 869	1 196 417	0,14
Cooperatieve Rabobank UA 0.50% 17 - 12.06.22	950 000	EUR	1 069 385	1 082 091	0,12
Cooperatieve Rabobank UA 4.50% 11 - 01.11.21	923 000	USD	949 121	943 579	0,11
Cooperatieve Rabobank UA 4.625% 13 - 12.01.23	2 835 000	USD	3 029 197	3 126 268	0,35
Deutsche Telekom International Finance BV 0.375% 17 - 30.10.21	1 150 000	EUR	1 280 810	1 296 326	0,15
Deutsche Telekom International Finance BV 0.625% 18 - 12.01.22	800 000	EUR	902 276	909 079	0,10
Innogy Finance BV 1.625% 18 - 30.05.26	200 000	EUR	236 683	241 185	0,03
JAB Holdings BV 1.75% 16 - 25.05.23	800 000	EUR	951 702	926 176	0,10
Koninklijke DSM NV 0.75% 16 - 28.09.26	100 000	EUR	114 211	116 586	0,01
LeasePlan Corp. NV 1.00% 16 - 24.05.21	2 000 000	EUR	2 220 590	2 238 416	0,25
Mylan NV 2.25% 16 - 22.11.24	390 000	EUR	448 007	458 546	0,05
Shell International Finance BV 1.625% 14 - 20.01.27	500 000	EUR	601 658	608 498	0,07
Vonovia Finance BV 0.875% 16 - 06.10.22	700 000	EUR	796 344	794 651	0,09
			20 617 457	20 919 533	2,37
Nouvelle-Zélande					
BNZ International Funding Ltd. 0.50% 17 - 13.05.23	1 405 000	EUR	1 560 168	1 587 134	0,18
			1 560 168	1 587 134	0,18
Norvège					
Avinor AS 1.00% 15 - 29.04.25	1 003 000	EUR	1 140 833	1 147 968	0,13
			1 140 833	1 147 968	0,13
Espagne					
Spain 2.90% 16 - 31.10.46	1 400 000	EUR	1 974 139	2 178 409	0,25
Spain 5.15% 13 - 31.10.28	2 600 000	EUR	3 836 976	4 091 857	0,46
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 98 - 31.01.24	2 600 000	EUR	2 845 494	2 942 121	0,33

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.01.23	1 200 000	EUR	1 370 488	1 357 268	0,15
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 15 - 30.07.22	900 000	EUR	980 231	1 017 668	0,12
Spain Government International Bond 5.25% 99 - 04.06.29	1 000 000	GBP	1 691 379	1 580 593	0,18
			12 698 707	13 167 916	1,49
Supranationales					
European Investment Bank 1.00% 16 - 14.04.32	500 000	EUR	596 438	641 055	0,07
			596 438	641 055	0,07
Suisse					
Credit Suisse AG 1.00% 16 - 06.07.23	1 606 000	EUR	1 763 303	1 850 782	0,21
UBS AG 1.375% 14 - 16.04.21	1 000 000	EUR	1 165 524	1 138 425	0,13
			2 928 827	2 989 207	0,34
Royaume-Uni					
AstraZeneca PLC 0.25% 16 - 05.12.21	300 000	EUR	333 687	337 245	0,04
AstraZeneca PLC 2.375% 15 - 16.11.20	400 000	USD	400 669	403 031	0,04
Bank of Scotland PLC 4.875% 04 - 20.12.24	2 100 000	GBP	3 244 616	3 075 955	0,35
G4S International Finance PLC 1.875% 18 - 24.05.25	1 700 000	EUR	1 935 711	1 853 543	0,21
GlaxoSmithKline Capital PLC 4.00% 05 - 16.06.25	1 600 000	EUR	2 183 010	2 136 884	0,24
HSBC Holdings PLC FRN 16 - 03.08.21	1 150 000	USD	1 181 728	1 164 732	0,13
Motability Operations Group PLC 0.375% 19 - 01.03.26	1 245 000	EUR	1 385 652	1 391 591	0,16
Motability Operations Group PLC 1.625% 15 - 06.09.23	2 413 000	EUR	2 821 489	2 834 562	0,32
Network Rail Infrastructure Finance PLC 2.75% 06 - 10.06.21	10 000 000	CHF	10 743 664	10 957 522	1,24
Prs Finance PLC 1.75% 16 - 24.11.26	26 476 549	GBP	36 101 011	34 958 851	3,97
Prs Finance PLC 2.00% 19 - 23.01.29	5 250 000	GBP	7 290 855	7 108 810	0,81
Royal Bank of Scotland Group PLC FRN 17 - 15.05.23	1 200 000	USD	1 200 876	1 200 744	0,14
United Kingdom Gilt 3.25% 12 - 22.01.44	1 000 000	GBP	1 937 230	1 940 674	0,22
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.375% 11 - 22.03.62	18 385 489	GBP	63 096 440	62 730 150	7,12
United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.875% 07 - 22.11.22	29 327 332	GBP	40 561 255	40 204 444	4,56
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	400 000	EUR	495 854	493 365	0,06
			174 913 747	172 792 103	19,61
États-Unis					
AbbVie Inc. 3.20% 16 - 14.05.26	200 000	USD	205 501	219 888	0,03
AbbVie Inc. 3.60% 15 - 14.05.25	400 000	USD	418 554	442 309	0,05
AbbVie Inc. 4.30% 16 - 14.05.36	200 000	USD	218 906	230 898	0,03
AbbVie Inc. 4.40% 13 - 11.06.42	250 000	USD	270 412	299 208	0,03
Aetna Inc. 3.50% 14 - 15.11.24	100 000	USD	103 959	108 362	0,01
Albemarle Corp. 1.875% 14 - 12.08.21	190 000	EUR	215 910	213 315	0,02
Altria Group Inc. 1.70% 19 - 15.06.25	1 100 000	EUR	1 292 352	1 268 833	0,14
Amazon.com Inc. 2.80% 18 - 22.08.24	200 000	USD	206 011	217 304	0,02
Amazon.com Inc. 3.15% 18 - 22.08.27	200 000	USD	211 278	228 896	0,03

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Amazon.com Inc. 4.95% 14 - 12.05.44	150 000	USD	196 249	214 046	0,02
Amgen Inc. 2.65% 17 - 05.11.22	215 000	USD	217 107	222 626	0,03
Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 3.30% 16 - 02.01.23	325 000	USD	330 778	344 231	0,04
Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 3.65% 16 - 02.01.26	200 000	USD	205 464	223 019	0,03
Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 3.70% 14 - 02.01.24	460 000	USD	475 932	505 641	0,06
Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 4.625% 14 - 02.01.44	100 000	USD	101 784	114 213	0,01
Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 4.90% 16 - 02.01.46	275 000	USD	288 184	334 684	0,04
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 3.50% 18 - 01.12.24	100 000	USD	102 800	108 959	0,01
Anthem Inc. 4.65% 14 - 15.08.44	450 000	USD	512 032	569 824	0,06
Apple Inc. 0.875% 17 - 24.05.25	300 000	EUR	346 414	352 184	0,04
Apple Inc. FRN 17 - 02.09.22	154 000	USD	154 912	154 881	0,02
Apple Inc. 2.15% 15 - 02.09.22	200 000	USD	201 076	205 775	0,02
Apple Inc. 2.40% 13 - 05.03.23	590 000	USD	598 876	623 671	0,07
Apple Inc. 2.45% 16 - 08.04.26	300 000	USD	304 217	325 949	0,04
Apple Inc. 2.50% 17 - 02.09.22	400 000	USD	404 086	413 530	0,05
Apple Inc. 3.70% 15 - 28.08.22	1 000 000	AUD	745 629	732 647	0,08
Apple Inc. 3.85% 13 - 05.04.43	500 000	USD	560 913	618 947	0,07
Apple Inc. 4.375% 15 - 13.05.45	175 000	USD	211 513	230 729	0,03
Apple Inc. 4.50% 16 - 23.02.36	200 000	USD	243 661	263 834	0,03
AT&T Inc. 1.05% 18 - 09.05.23	650 000	EUR	738 322	737 779	0,08
AT&T Inc. FRN 18 - 06.01.21	522 000	USD	524 498	524 644	0,06
AT&T Inc. 1.80% 18 - 09.05.26	1 000 000	EUR	1 186 374	1 173 175	0,13
AT&T Inc. FRN 17 - 15.07.21	1 128 000	USD	1 135 022	1 137 193	0,13
AT&T Inc. 2.45% 15 - 15.03.35	300 000	EUR	361 916	357 588	0,04
AT&T Inc. 2.75% 16 - 19.05.23	700 000	EUR	842 923	836 200	0,09
AT&T Inc. 3.55% 12 - 17.12.32	1 100 000	EUR	1 554 835	1 481 544	0,17
Bank of America Corp. 1.375% 14 - 09.10.21	1 000 000	EUR	1 128 806	1 139 652	0,13
Bank of America Corp. 1.625% 15 - 14.09.22	100 000	EUR	116 714	115 542	0,01
Bank of America Corp. FRN 17 - 21.07.23	1 000 000	USD	1 016 440	1 038 689	0,12
Bank of America Corp. FRN 17 - 24.04.23	525 000	USD	532 599	544 206	0,06
Bank of New York Mellon Corp. 2.60% 15 - 17.08.20	600 000	USD	600 558	600 536	0,07
BAT Capital Corp. 2.764% 18 - 15.08.22	550 000	USD	558 774	569 503	0,06
Bayer US Finance II LLC FRN 18 - 15.12.23	800 000	USD	813 220	797 538	0,09
BMW US Capital LLC 1.125% 15 - 18.09.21	850 000	EUR	958 052	967 274	0,11
BorgWarner Inc. 1.80% 15 - 11.07.22	100 000	EUR	114 977	113 914	0,01
BP Capital Markets America Inc. 4.50% 18 - 10.01.20	1 000 000	USD	1 016 640	1 009 280	0,11
Coca-Cola Co. 1.875% 14 - 22.09.26	500 000	EUR	624 298	617 755	0,07
Comcast Corp. 3.30% 17 - 02.01.27	550 000	USD	541 300	616 742	0,07
Dover Corp. 1.25% 16 - 11.09.26	200 000	EUR	230 335	225 047	0,03
Exelon Corp. 3.497% 17 - 06.01.22	600 000	USD	615 265	627 935	0,07
Federal National Mortgage Association 5.375% 98 - 12.07.28	2 820 000	GBP	4 976 986	4 783 926	0,54

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Illinois Tool Works Inc. 0.625% 19 - 12.05.27	700 000	EUR	790 456	790 198	0,09
JPMorgan Chase & Co. FRN 16 - 24.10.23	919 000	USD	927 928	929 284	0,11
JPMorgan Chase & Co. 2.295% 16 - 15.08.21	400 000	USD	399 032	400 836	0,05
JPMorgan Chase & Co. 2.70% 16 - 18.05.23	425 000	USD	426 197	447 957	0,05
JPMorgan Chase & Co. 2.95% 16 - 10.01.26	100 000	USD	100 068	109 831	0,01
JPMorgan Chase & Co. 2.972% 16 - 15.01.23	900 000	USD	908 316	931 921	0,11
JPMorgan Chase & Co. 3.125% 15 - 23.01.25	100 000	USD	101 376	108 989	0,01
JPMorgan Chase & Co. 3.625% 14 - 13.05.24	425 000	USD	439 486	469 342	0,05
JPMorgan Chase & Co. 3.625% 16 - 12.01.27	150 000	USD	151 839	165 922	0,02
JPMorgan Chase & Co. 3.90% 15 - 15.07.25	200 000	USD	209 492	226 219	0,03
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 15.11.48	425 000	USD	433 193	519 766	0,06
JPMorgan Chase & Co. FRN 18 - 23.04.29	200 000	USD	209 803	230 782	0,03
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 22.02.48	125 000	USD	134 060	157 488	0,02
JPMorgan Chase & Co. 4.95% 15 - 06.01.45	100 000	USD	114 486	134 531	0,02
Microsoft Corp. 2.40% 16 - 08.08.26	525 000	USD	504 954	573 013	0,07
Moody's Corp. 0.95% 19 - 25.02.30	1 005 000	EUR	1 151 128	1 153 109	0,13
Pfizer Inc. 0.25% 17 - 03.06.22	650 000	EUR	740 927	733 132	0,08
Praxair Inc. 1.625% 14 - 12.01.25	2 494 000	EUR	2 992 050	3 006 529	0,34
Verizon Communications Inc. 4.15% 14 - 15.03.24	2 234 000	USD	2 391 810	2 486 464	0,28
Wells Fargo & Co. 3.30% 14 - 09.09.24	575 000	USD	605 096	629 942	0,07
			43 265 061	44 009 320	4,99
Total - Obligations			805 995 992	807 516 567	91,63
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			805 995 992	807 516 567	91,63
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Australie					
New South Wales Treasury Corp. 3.00% 17 - 20.04.29	10 000 000	AUD	7 185 076	7 899 435	0,90
Western Australian Treasury Corp. 2.75% 19 - 24.07.29	10 000 000	AUD	7 017 416	7 750 237	0,88
			14 202 492	15 649 672	1,78
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 11.01.24	1 300 000	EUR	1 360 680	1 419 636	0,16
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 11.01.25	5 700 000	EUR	5 997 012	6 132 305	0,69
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.26	9 000 000	EUR	9 447 031	9 596 463	1,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.22	3 200 000	EUR	3 512 023	3 579 524	0,41

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 12 - 09.01.22	3 000 000	EUR	3 297 074	3 360 353	0,38
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Hybrid Strip Zero Coupon 10 - 03.01.25	5 400 000	EUR	5 762 465	5 885 546	0,67
			29 376 285	29 973 827	3,40
Japon					
Japanese Government CPI Linked Bond 0.10% 13 - 09.10.23	167 525 300	JPY	1 580 312	1 552 814	0,18
			1 580 312	1 552 814	0,18
États-Unis					
Anheuser-Busch Cos LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.70% 18 - 02.01.36	200 000	USD	210 116	235 615	0,03
Anheuser-Busch Cos LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.90% 18 - 02.01.46	400 000	USD	422 940	489 474	0,05
Bank of America Corp. FRN 17 - 20.12.23	1 000 000	USD	1 024 470	1 050 410	0,12
Bank of America Corp. FRN 17 - 20.12.28	600 000	USD	632 190	668 311	0,08
Equitable Holdings Inc. 5.00% 19 - 20.04.48	100 000	USD	108 417	114 411	0,01
			2 398 133	2 558 221	0,29
Total - Obligations			47 557 222	49 734 534	5,65
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			47 557 222	49 734 534	5,65
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
Obligations					
Allemagne					
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 2.70% 17 - 19.06.23	15 000 000	AUD	10 862 114	10 924 945	1,24
			10 862 114	10 924 945	1,24
Total - Obligations			10 862 114	10 924 945	1,24
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			10 862 114	10 924 945	1,24
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			864 415 328	868 176 046	98,52
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				871 773 142	98,92

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations					
Autriche					
Novomatic AG 1.625% 16 - 20.09.23	700 000	EUR	674 055	630 773	0,16
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 5.875% 13 - 27.11.23	200 000	EUR	217 353	214 286	0,05
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 5.875% 13 - 27.11.23	200 000	EUR	223 176	214 286	0,05
Sappi Papier Holding GmbH 3.125% 19 - 15.04.26	650 000	EUR	628 472	554 125	0,14
Sappi Papier Holding GmbH 4.00% 16 - 04.01.23	500 000	EUR	477 536	455 750	0,11
Wienerberger AG 2.00% 18 - 05.02.24	350 000	EUR	359 743	351 371	0,09
Wienerberger AG 2.75% 20 - 06.04.25	200 000	EUR	198 867	202 923	0,05
			2 779 202	2 623 514	0,65
Belgique					
House of Finance NV 4.375% 19 - 15.07.26	400 000	EUR	403 814	348 926	0,09
House of Finance NV 4.375% 19 - 15.07.26	100 000	EUR	73 207	87 231	0,02
Sarens Finance Co. NV 5.75% 20 - 21.02.27	400 000	EUR	365 662	310 200	0,08
			842 683	746 357	0,19
Brésil					
BRF SA 2.75% 15 - 06.03.22	500 000	EUR	500 147	495 265	0,12
			500 147	495 265	0,12
Îles Vierges britanniques					
Fortune Star BVI Ltd. 4.35% 19 - 05.06.23	600 000	EUR	584 022	580 650	0,14
			584 022	580 650	0,14
Bulgarie					
Bulgarian Energy Holding EAD 3.50% 18 - 28.06.25	850 000	EUR	885 321	862 311	0,22
Bulgarian Energy Holding EAD 4.875% 16 - 08.02.21	750 000	EUR	776 652	762 915	0,19
			1 661 973	1 625 226	0,41
Canada					
Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15 - 15.05.23	2 200 000	EUR	2 171 487	2 173 478	0,55
Primo Water Corp. 5.50% 16 - 07.01.24	650 000	EUR	665 208	650 886	0,16
			2 836 695	2 824 364	0,71
République tchèque					
Energo-Pro AS 4.00% 17 - 12.07.22	500 000	EUR	495 758	477 183	0,12
Energo-Pro AS 4.50% 18 - 05.04.24	450 000	EUR	445 987	423 134	0,11
Sazka Group AS 3.875% 20 - 15.02.27	280 000	EUR	275 328	248 509	0,06
Sazka Group AS 3.875% 20 - 15.02.27	200 000	EUR	165 368	177 507	0,04
Sazka Group AS 4.125% 19 - 20.11.24	400 000	EUR	386 740	383 027	0,10
			1 769 181	1 709 360	0,43
Danemark					
DKT Finance ApS 7.00% 18 - 17.06.23	1 550 000	EUR	1 584 042	1 540 446	0,39
Norican A/S 4.50% 17 - 15.05.23	500 000	EUR	438 432	358 750	0,09
TDC A/S 5.00% 12 - 03.02.22	700 000	EUR	738 114	726 740	0,18
			2 760 588	2 625 936	0,66
Finlande					
Nokia OYJ 1.00% 17 - 15.03.21	500 000	EUR	499 633	500 592	0,13
Nokia OYJ 2.00% 17 - 15.03.24	1 100 000	EUR	1 124 883	1 116 979	0,28
Nokia OYJ 2.00% 19 - 03.11.26	1 150 000	EUR	1 133 307	1 139 981	0,29
Nokia OYJ 2.375% 20 - 15.05.25	700 000	EUR	712 054	718 730	0,18
Nokia OYJ 3.125% 20 - 15.05.28	700 000	EUR	715 593	722 142	0,18
Outokumpu OYJ 4.125% 18 - 18.06.24	340 000	EUR	326 545	326 400	0,08

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Finlande (suite)					
Teollisuuden Voima OYJ 1.125% 19 - 03.09.26	950 000	EUR	928 612	878 404	0,22
Teollisuuden Voima OYJ 2.00% 18 - 05.08.24	600 000	EUR	609 758	596 746	0,15
Teollisuuden Voima OYJ 2.125% 15 - 02.04.25	360 000	EUR	364 916	354 926	0,09
Teollisuuden Voima OYJ 2.125% 15 - 02.04.25	300 000	EUR	300 096	295 772	0,07
Teollisuuden Voima OYJ 2.625% 16 - 13.01.23	800 000	EUR	826 950	817 547	0,20
			7 542 347	7 468 219	1,87
France					
3AB Optique Developpement SAS 4.00% 17 - 10.01.23	300 000	EUR	275 700	288 788	0,07
Altice France SA 2.125% 20 - 15.02.25	700 000	EUR	680 369	652 491	0,16
Altice France SA 2.50% 19 - 15.01.25	750 000	EUR	748 200	712 861	0,18
Altice France SA 3.375% 19 - 15.01.28	1 400 000	EUR	1 393 940	1 321 181	0,33
Altice France SA 5.875% 18 - 02.01.27	1 450 000	EUR	1 532 808	1 522 840	0,38
Banjay Entertainment SASU 3.50% 20 - 03.01.25	850 000	EUR	835 287	806 676	0,20
Banjay Group SAS 6.50% 20 - 03.01.26	540 000	EUR	523 361	481 528	0,12
Burger King France SAS FRN 17 - 05.01.23	500 000	EUR	488 804	477 419	0,12
Burger King France SAS 6.00% 17 - 05.01.24	450 000	EUR	461 115	448 713	0,11
Casino Guichard Perrachon SA 1.865% 17 - 13.06.22	600 000	EUR	557 572	576 507	0,14
Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 14 - 02.07.25	200 000	EUR	191 743	169 556	0,04
Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 14 - 02.07.25	500 000	EUR	420 317	423 891	0,11
Casino Guichard Perrachon SA 4.498% 14 - 03.07.24	1 300 000	EUR	1 200 031	1 168 318	0,29
Casino Guichard Perrachon SA 4.561% 13 - 25.01.23	1 000 000	EUR	978 756	955 349	0,24
Casino Guichard Perrachon SA 5.976% 11 - 26.05.21	900 000	EUR	910 089	908 369	0,23
CMA CGM SA 5.25% 17 - 15.01.25	1 100 000	EUR	845 368	902 000	0,23
CMA CGM SA 6.50% 17 - 15.07.22	950 000	EUR	856 952	880 422	0,22
CMA CGM SA 7.75% 15 - 15.01.21	724 138	EUR	688 577	715 189	0,18
Constellium SE 4.25% 17 - 15.02.26	600 000	EUR	594 044	586 500	0,15
Crown European Holdings SA 0.75% 19 - 15.02.23	800 000	EUR	788 338	769 430	0,19
Crown European Holdings SA 2.25% 18 - 02.01.23	500 000	EUR	510 898	499 534	0,12
Crown European Holdings SA 2.625% 16 - 30.09.24	850 000	EUR	870 948	857 286	0,21
Crown European Holdings SA 2.875% 18 - 02.01.26	760 000	EUR	780 110	768 143	0,19
Crown European Holdings SA 3.375% 15 - 15.05.25	850 000	EUR	888 606	880 028	0,22
Crown European Holdings SA 4.00% 14 - 15.07.22	850 000	EUR	898 820	878 484	0,22
Elis SA 1.00% 19 - 04.03.25	400 000	EUR	386 982	361 032	0,09
Elis SA 1.00% 19 - 04.03.25	300 000	EUR	288 087	270 774	0,07
Elis SA 1.625% 19 - 04.03.28	500 000	EUR	488 255	453 314	0,11
Elis SA 1.75% 19 - 04.11.24	700 000	EUR	706 428	671 085	0,17
Elis SA 1.875% 18 - 15.02.23	1 000 000	EUR	998 578	974 276	0,24
Elis SA 2.875% 18 - 15.02.26	500 000	EUR	500 689	492 014	0,12
Europcar Mobility Group 4.00% 19 - 30.04.26	700 000	EUR	580 813	523 385	0,13
Europcar Mobility Group 4.125% 17 - 15.11.24	850 000	EUR	716 611	648 988	0,16
Faurecia SE 2.375% 19 - 15.06.27	1 000 000	EUR	970 502	930 569	0,23
Faurecia SE 2.625% 18 - 15.06.25	1 000 000	EUR	990 139	968 857	0,24
Faurecia SE 3.125% 19 - 15.06.26	1 100 000	EUR	1 101 413	1 072 585	0,27
Fnac Darty SA 1.875% 19 - 30.05.24	400 000	EUR	391 288	388 299	0,10
Fnac Darty SA 2.625% 19 - 30.05.26	500 000	EUR	506 736	488 528	0,12
Getlink SE 3.625% 18 - 10.01.23	800 000	EUR	803 380	810 120	0,20
Kapla Holding SAS 3.375% 19 - 15.12.26	300 000	EUR	289 753	265 608	0,07

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Kapla Holdings SAS FRN 19 - 15.12.26	500 000	EUR	478 738	446 629	0,11
Kapla Holdings SAS 3.375% 19 - 15.12.26	400 000	EUR	370 851	354 144	0,09
La Financiere Atalian SASU 4.00% 17 - 15.05.24	900 000	EUR	708 834	670 776	0,17
La Financiere Atalian SASU 5.125% 18 - 15.05.25	450 000	EUR	339 591	335 396	0,08
Louvre Bidco SAS 4.25% 17 - 30.09.24	350 000	EUR	337 739	326 113	0,08
Loxam SAS 2.875% 19 - 15.04.26	400 000	EUR	375 257	342 582	0,09
Loxam SAS 3.25% 19 - 14.01.25	950 000	EUR	913 783	864 403	0,22
Loxam SAS 3.50% 16 - 05.03.23	300 000	EUR	291 299	286 211	0,07
Loxam SAS 3.50% 17 - 15.04.22	400 000	EUR	392 945	390 344	0,10
Loxam SAS 3.75% 19 - 15.07.26	600 000	EUR	601 782	549 821	0,14
Loxam SAS 4.25% 17 - 15.04.24	500 000	EUR	501 747	475 688	0,12
Loxam SAS 5.75% 19 - 15.07.27	400 000	EUR	349 399	313 759	0,08
Loxam SAS 6.00% 17 - 15.04.25	350 000	EUR	287 093	297 706	0,07
Mobilux Finance SAS 5.50% 16 - 15.11.24	550 000	EUR	539 867	524 814	0,13
Nexans SA 3.25% 16 - 26.05.21	300 000	EUR	301 984	301 324	0,08
Nexans SA 3.75% 18 - 08.08.23	200 000	EUR	211 504	205 450	0,05
Nexans SA 3.75% 18 - 08.08.23	300 000	EUR	308 202	308 175	0,08
Novafives SAS FRN 18 - 15.06.25	450 000	EUR	376 473	306 068	0,08
Novafives SAS 5.00% 18 - 15.06.25	450 000	EUR	373 233	310 013	0,08
Orano SA 3.125% 14 - 20.03.23	1 100 000	EUR	1 128 897	1 113 318	0,28
Orano SA 3.25% 13 - 09.04.20	600 000	EUR	602 283	601 500	0,15
Orano SA 3.375% 19 - 23.04.26	200 000	EUR	202 555	200 037	0,05
Orano SA 3.375% 19 - 23.04.26	900 000	EUR	927 254	900 167	0,23
Orano SA 3.50% 10 - 22.03.21	1 000 000	EUR	1 015 237	1 007 310	0,25
Paprec Holding SA 4.00% 18 - 31.03.25	800 000	EUR	718 462	718 351	0,18
Parts Europe SA 4.375% 16 - 05.01.22	350 000	EUR	337 321	336 854	0,08
Parts Europe SA FRN 16 - 05.01.22	688 156	EUR	652 760	660 686	0,17
Picard Groupe SAS FRN 17 - 30.11.23	1 800 000	EUR	1 752 228	1 724 522	0,43
Quatrim SASU 5.875% 19 - 15.01.24	850 000	EUR	861 544	868 725	0,22
Quatrim SASU 5.875% 19 - 15.01.24	300 000	EUR	313 612	306 609	0,08
Renault SA 1.00% 17 - 03.08.23	1 100 000	EUR	1 085 658	1 049 483	0,26
Renault SA 1.00% 17 - 28.11.25	1 000 000	EUR	931 515	918 003	0,23
Renault SA 1.00% 17 - 28.11.25	100 000	EUR	92 373	91 800	0,02
Renault SA 1.00% 18 - 18.04.24	1 000 000	EUR	961 345	925 866	0,23
Renault SA 1.125% 19 - 10.04.27	700 000	EUR	632 248	600 518	0,15
Renault SA 1.25% 19 - 24.06.25	900 000	EUR	855 218	820 644	0,21
Renault SA 1.25% 19 - 24.06.25	500 000	EUR	445 689	455 914	0,11
Renault SA 2.00% 18 - 28.09.26	1 100 000	EUR	1 039 526	1 020 206	0,25
Rexel SA 2.125% 17 - 15.06.25	750 000	EUR	735 774	732 603	0,18
Rexel SA 2.625% 17 - 15.06.24	350 000	EUR	345 971	347 212	0,09
Rexel SA 2.75% 19 - 15.06.26	900 000	EUR	894 644	890 620	0,22
Rubis Terminal Infra SAS 5.625% 20 - 15.05.25	600 000	EUR	614 414	621 026	0,16
SPCM SA 2.875% 15 - 15.06.23	750 000	EUR	752 307	742 697	0,19
Spie SA 2.625% 19 - 18.06.26	900 000	EUR	902 390	869 946	0,22
SPIE SA 3.125% 17 - 22.03.24	800 000	EUR	828 462	796 644	0,20
Tereos Finance Groupe ISA 4.125% 16 - 16.06.23	900 000	EUR	753 550	774 869	0,19
Vallourec SA 2.25% 14 - 30.09.24	800 000	EUR	576 306	418 528	0,10
Vallourec SA 6.375% 18 - 15.10.23	300 000	EUR	270 648	178 510	0,04

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Vallourec SA 6.375% 18 - 15.10.23	200 000	EUR	109 762	119 007	0,03
Vallourec SA 6.625% 17 - 15.10.22	850 000	EUR	731 903	530 400	0,13
			58 772 584	56 922 928	14,22
Allemagne					
Adler Pelzer Holding GmbH 4.125% 17 - 04.01.24	300 000	EUR	291 670	214 800	0,05
Adler Pelzer Holdings GmbH 4.125% 17 - 04.01.24	200 000	EUR	155 831	143 200	0,04
ADLER Real Estate AG 1.50% 17 - 12.06.21	700 000	EUR	700 034	685 059	0,17
ADLER Real Estate AG 1.50% 19 - 17.04.22	600 000	EUR	595 482	582 555	0,15
ADLER Real Estate AG 1.875% 18 - 27.04.23	700 000	EUR	699 993	676 606	0,17
ADLER Real Estate AG 2.125% 17 - 02.06.24	490 000	EUR	473 339	471 927	0,12
ADLER Real Estate AG 3.00% 18 - 27.04.26	400 000	EUR	416 059	395 708	0,10
Bilfinger SE 5.75% 19 - 14.06.24	400 000	EUR	402 882	403 000	0,10
CeramTec BondCo GmbH 5.25% 17 - 15.12.25	550 000	EUR	547 189	535 150	0,13
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 20 - 02.11.27	680 000	EUR	672 976	658 297	0,16
Commerzbank AG 4.00% 16 - 23.03.26	1 500 000	EUR	1 509 721	1 553 994	0,39
Commerzbank AG 4.00% 17 - 30.03.27	900 000	EUR	899 683	931 129	0,23
Consus Real Estate AG 9.625% 19 - 15.05.24	600 000	EUR	588 962	651 067	0,16
DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.875% 19 - 15.10.24	400 000	EUR	401 058	378 403	0,09
DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.875% 19 - 15.10.24	500 000	EUR	479 005	473 004	0,12
Deutsche Bank AG 2.75% 15 - 17.02.25	1 800 000	EUR	1 792 996	1 786 547	0,45
Deutsche Bank AG 4.50% 16 - 19.05.26	500 000	EUR	531 858	514 732	0,13
Deutsche Bank AG 4.50% 16 - 19.05.26	600 000	EUR	618 334	617 679	0,15
Deutsche Lufthansa AG 0.25% 19 - 09.06.24	700 000	EUR	611 886	617 525	0,15
Douglas GmbH 6.25% 15 - 15.07.22	400 000	EUR	362 119	335 114	0,08
Hapag-Lloyd AG 5.125% 17 - 15.07.24	650 000	EUR	650 266	652 979	0,16
Hornbach Baumarkt AG 3.25% 19 - 25.10.26	100 000	EUR	101 538	100 971	0,03
Hornbach Baumarkt AG 3.25% 19 - 25.10.26	300 000	EUR	303 113	302 912	0,08
INEOS Styrolution Group GmbH 2.25% 20 - 16.01.27	900 000	EUR	844 615	824 786	0,21
K+S AG 2.625% 17 - 04.06.23	880 000	EUR	846 322	777 759	0,19
K+S AG 3.00% 12 - 20.06.22	300 000	EUR	313 651	278 250	0,07
K+S AG 3.00% 12 - 20.06.22	400 000	EUR	398 341	371 000	0,09
K+S AG 3.25% 18 - 18.07.24	900 000	EUR	844 191	768 405	0,19
K+S AG 4.125% 13 - 12.06.21	694 000	EUR	712 030	679 787	0,17
Kaefer Isoliertechnik GmbH & Co. KG 5.50% 18 - 01.10.24	320 000	EUR	297 775	288 817	0,07
Kirk Beauty One GmbH 8.75% 15 - 15.07.23	100 000	EUR	88 611	48 667	0,01
Kirk Beauty One GmbH 8.75% 15 - 15.07.23	400 000	EUR	243 128	194 667	0,05
KME SE 6.75% 18 - 02.01.23	400 000	EUR	326 527	260 400	0,07
METRO AG 1.375% 14 - 28.10.21	680 000	EUR	682 032	676 854	0,17
METRO AG 1.50% 15 - 19.03.25	900 000	EUR	894 950	883 632	0,22
Nidda BondCo GmbH 5.00% 17 - 30.09.25	550 000	EUR	539 253	539 700	0,14
Nidda BondCo GmbH 7.25% 18 - 30.09.25	350 000	EUR	351 762	355 827	0,09
Nidda Healthcare Holding GmbH 3.50% 17 - 30.09.24	2 400 000	EUR	2 392 271	2 359 245	0,59
Nordex SE 6.50% 18 - 02.01.23	400 000	EUR	389 517	396 000	0,10
Novem Group GmbH FRN 19 - 15.05.24	600 000	EUR	532 553	558 000	0,14

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Allemagne (suite)					
Peach Property Finance GmbH 3.50% 19 - 15.02.23	400 000	EUR	397 965	395 488	0,10
Platin 1426 GmbH 5.375% 17 - 15.06.23	550 000	EUR	521 857	507 925	0,13
PrestigeBidCo GmbH 6.25% 16 - 15.12.23	400 000	EUR	402 453	401 988	0,10
ProGroup AG 3.00% 18 - 31.03.26	900 000	EUR	876 054	873 562	0,22
Raffinerie Heide GmbH 6.375% 17 - 12.01.22	400 000	EUR	324 122	271 950	0,07
Safari Verwaltungs GmbH 5.375% 17 - 30.11.22	500 000	EUR	430 242	435 714	0,11
SGL Carbon SE 4.625% 19 - 30.09.24	350 000	EUR	309 588	276 792	0,07
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 18 - 30.07.26	600 000	EUR	616 458	611 975	0,15
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2.00% 20 - 15.07.25	1 650 000	EUR	1 623 609	1 571 160	0,39
Tele Columbus AG 3.875% 18 - 05.02.25	950 000	EUR	887 982	882 645	0,22
thyssenkrupp AG 1.375% 17 - 03.03.22	1 750 000	EUR	1 733 668	1 699 184	0,43
thyssenkrupp AG 1.75% 15 - 25.11.20	1 050 000	EUR	1 049 985	1 041 299	0,26
thyssenkrupp AG 1.875% 19 - 03.06.23	1 400 000	EUR	1 359 904	1 342 818	0,34
thyssenkrupp AG 2.50% 15 - 25.02.25	900 000	EUR	890 015	844 285	0,21
thyssenkrupp AG 2.75% 16 - 03.08.21	1 250 000	EUR	1 253 177	1 242 830	0,31
thyssenkrupp AG 2.875% 19 - 22.02.24	2 100 000	EUR	2 070 904	2 017 197	0,50
TUI AG 2.125% 16 - 26.10.21	400 000	EUR	405 725	328 374	0,08
WEPA Hygieneprodukte GmbH 2.875% 19 - 15.12.27	540 000	EUR	534 533	526 770	0,13
			40 191 764	39 216 110	9,80
Guernesey					
Summit Properties Ltd. 2.00% 18 - 31.01.25	400 000	EUR	371 299	364 250	0,09
			371 299	364 250	0,09
Irlande					
Bank of Ireland 10.00% 12 - 19.12.22	300 000	EUR	356 187	351 477	0,09
Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance PLC 5.15% 19 - 20.02.24	550 000	EUR	557 129	567 417	0,14
eircom Finance Dac 3.50% 19 - 15.05.26	1 000 000	EUR	1 015 968	1 003 160	0,25
eircom Finance DAC 1.75% 19 - 11.01.24	500 000	EUR	492 078	475 356	0,12
eircom Finance DAC 2.625% 19 - 15.02.27	550 000	EUR	527 454	524 554	0,13
James Hardie International Finance DAC 3.625% 18 - 10.01.26	600 000	EUR	597 279	607 154	0,15
Motion Bondco DAC 4.50% 19 - 15.11.27	500 000	EUR	489 668	438 963	0,11
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.375% 17 - 02.01.24	750 000	EUR	775 596	765 165	0,19
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.75% 15 - 02.01.25	400 000	EUR	418 613	412 030	0,11
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.875% 18 - 15.01.26	1 400 000	EUR	1 470 712	1 445 411	0,36
Smurfit Kappa Treasury ULC 1.50% 19 - 15.09.27	1 050 000	EUR	1 036 335	1 005 076	0,25
			7 737 019	7 595 763	1,90
Île de Man					
Playtech PLC 3.75% 18 - 10.12.23	750 000	EUR	732 800	740 080	0,19
Playtech PLC 4.25% 19 - 03.07.26	500 000	EUR	483 884	492 693	0,12
			1 216 684	1 232 773	0,31
Italie					
Almaviva-The Italian Innovation Co. SpA 7.25% 17 - 15.10.22	400 000	EUR	343 749	353 867	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Amplifon SpA 1.125% 20 - 13.02.27	300 000	EUR	298 913	292 343	0,07
Amplifon SpA 1.125% 20 - 13.02.27	200 000	EUR	180 013	194 895	0,05
Atlantia SpA 1.625% 17 - 02.03.25	1 050 000	EUR	1 019 397	985 509	0,25
Atlantia SpA 1.875% 17 - 13.07.27	1 400 000	EUR	1 348 608	1 301 468	0,33
Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 16 - 02.01.27	900 000	EUR	857 512	819 270	0,20
Autostrade per l'Italia SpA 1.875% 15 - 11.04.25	650 000	EUR	625 776	597 011	0,15
Banca del Mezzogiorno-MedioCredito Centrale SpA 1.50% 19 - 24.10.24	400 000	EUR	391 553	393 040	0,10
Banca Farmafactoring SpA 1.75% 19 - 23.05.23	400 000	EUR	398 454	387 333	0,10
Banca IFIS SpA 1.75% 20 - 25.06.24	600 000	EUR	568 849	552 540	0,14
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.625% 20 - 28.04.25	1 000 000	EUR	938 834	977 388	0,24
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.625% 19 - 24.09.24	1 100 000	EUR	1 104 910	1 119 174	0,28
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 4.00% 19 - 07.10.22	750 000	EUR	759 821	763 986	0,19
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 10.50% 19 - 23.07.29	450 000	EUR	411 096	494 100	0,12
Banca Popolare di Sondrio SCPA 2.375% 19 - 04.03.24	750 000	EUR	722 271	736 676	0,18
Banco BPM SpA 1.625% 20 - 18.02.25	1 000 000	EUR	949 356	920 820	0,23
Banco BPM SpA 1.75% 18 - 24.04.23	750 000	EUR	737 418	750 003	0,19
Banco BPM SpA 1.75% 19 - 28.01.25	600 000	EUR	591 568	592 529	0,15
Banco BPM SpA 1.75% 19 - 28.01.25	150 000	EUR	149 560	148 132	0,04
Banco BPM SpA 2.00% 19 - 03.08.22	1 100 000	EUR	1 096 254	1 103 235	0,28
Banco BPM SpA 2.50% 19 - 21.06.24	700 000	EUR	700 042	711 930	0,18
Banco BPM SpA 2.75% 15 - 27.07.20	1 400 000	EUR	1 401 808	1 401 345	0,35
Banco BPM SpA 6.00% 10 - 11.05.20	1 040 000	EUR	1 051 648	1 047 887	0,26
Banco BPM SpA 6.375% 11 - 31.05.21	420 000	EUR	435 120	428 798	0,11
Banco BPM SpA 7.125% 11 - 03.01.21	650 000	EUR	666 029	663 384	0,17
Bormioli Pharma Bidco SpA FRN 17 - 15.11.24	380 000	EUR	353 644	337 630	0,08
Credito Valtellinese SpA 2.00% 19 - 27.11.22	400 000	EUR	396 525	377 916	0,09
Diocle Spa FRN 19 - 30.06.26	622 340	EUR	620 479	611 605	0,15
Esselunga SpA 0.875% 17 - 25.10.23	700 000	EUR	695 199	688 912	0,17
Esselunga SpA 1.875% 17 - 25.10.27	700 000	EUR	703 029	691 743	0,17
EVOCA SpA FRN 19 - 11.01.26	800 000	EUR	734 651	681 500	0,17
Fabric BC SpA FRN 18 - 30.11.24	900 000	EUR	875 469	878 625	0,22
Fire BC SpA FRN 18 - 30.09.24	1 000 000	EUR	940 132	882 292	0,22
Guala Closures SpA FRN 18 - 15.04.24	600 000	EUR	598 162	587 529	0,15
Iccrea Banca SpA FRN 18 - 02.01.21	600 000	EUR	598 489	598 044	0,15
Iccrea Banca SpA 1.50% 17 - 10.11.22	800 000	EUR	799 885	789 989	0,20
Immobiliare Grande Distribuzione SIHQ SpA 2.125% 19 - 28.11.24	600 000	EUR	519 826	502 121	0,13
International Design Group SPA FRN 18 - 15.11.25	480 000	EUR	449 416	438 612	0,11
International Design Group SPA 6.50% 18 - 15.11.25	560 000	EUR	536 383	516 600	0,13
Intesa Sanpaolo SpA 2.855% 15 - 23.04.25	800 000	EUR	825 096	812 933	0,20
Intesa Sanpaolo SpA 5.15% 10 - 16.07.20	1 300 000	EUR	1 302 037	1 301 646	0,33
Intesa Sanpaolo SpA 6.625% 13 - 13.09.23	2 000 000	EUR	2 256 212	2 269 610	0,57

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Leonardo SpA 1.50% 17 - 06.07.24	900 000	EUR	893 477	891 750	0,22
Leonardo SpA 4.50% 13 - 19.01.21	1 050 000	EUR	1 071 124	1 068 801	0,27
Limacorporate SpA FRN 17 - 15.08.23	420 000	EUR	409 103	403 988	0,10
LKQ Italia Bondco SpA 3.875% 16 - 04.01.24	700 000	EUR	737 136	722 371	0,18
Marcolin SpA FRN 17 - 15.02.23	400 000	EUR	334 406	335 770	0,08
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 3.75% 16 - 16.06.26	390 000	EUR	410 088	412 188	0,10
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 5.00% 10 - 15.11.20	850 000	EUR	862 797	859 658	0,21
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 5.75% 13 - 18.04.23	750 000	EUR	818 345	815 282	0,20
Nexi SpA 1.75% 19 - 31.10.24	800 000	EUR	805 451	776 771	0,19
Nexi SpA 1.75% 19 - 31.10.24	400 000	EUR	392 637	388 385	0,10
Piaggio & C SpA 3.625% 18 - 30.04.25	350 000	EUR	341 143	343 833	0,09
Pro-Gest SpA 3.25% 17 - 15.12.24	400 000	EUR	296 633	262 000	0,07
Rekeep SpA 9.00% 17 - 15.06.22	500 000	EUR	458 017	484 643	0,12
Sisal Group SpA 7.00% 16 - 31.07.23	412 500	EUR	408 516	408 559	0,10
Sisal Pay SpA FRN 19 - 17.12.26	800 000	EUR	770 851	770 221	0,19
TeamSystem SpA FRN 18 - 15.04.23	778 000	EUR	767 169	768 586	0,19
Telecom Italia SpA 2.375% 17 - 10.12.27	1 450 000	EUR	1 411 474	1 413 404	0,35
Telecom Italia SpA 2.50% 17 - 19.07.23	1 200 000	EUR	1 230 860	1 218 449	0,30
Telecom Italia SpA 2.75% 19 - 15.04.25	1 150 000	EUR	1 161 619	1 150 379	0,29
Telecom Italia SpA 2.875% 18 - 28.01.26	800 000	EUR	815 297	804 937	0,20
Telecom Italia SpA 3.00% 16 - 30.09.25	1 150 000	EUR	1 181 295	1 166 816	0,29
Telecom Italia SpA 3.25% 15 - 16.01.23	1 100 000	EUR	1 140 378	1 142 621	0,29
Telecom Italia SpA 3.625% 16 - 19.01.24	800 000	EUR	845 918	829 964	0,21
Telecom Italia SpA 3.625% 16 - 25.05.26	1 200 000	EUR	1 272 310	1 249 293	0,31
Telecom Italia SpA 4.00% 19 - 04.11.24	1 400 000	EUR	1 479 499	1 463 659	0,37
Telecom Italia SpA 4.50% 14 - 25.01.21	700 000	EUR	713 038	713 019	0,18
Telecom Italia SpA 4.875% 13 - 25.09.20	550 000	EUR	555 615	554 341	0,14
UniCredit SpA 6.95% 12 - 31.10.22	2 100 000	EUR	2 271 066	2 309 221	0,58
Unione di Banche Italiane SpA 1.625% 19 - 21.04.25	750 000	EUR	723 937	730 165	0,18
Unione di Banche Italiane SpA 1.75% 18 - 04.12.23	600 000	EUR	593 751	595 103	0,15
Unione di Banche Italiane SpA 2.625% 19 - 20.06.24	800 000	EUR	814 855	813 921	0,20
Unipol Gruppo SpA 3.00% 15 - 18.03.25	1 400 000	EUR	1 424 900	1 429 158	0,36
Unipol Gruppo SpA 3.50% 17 - 29.11.27	650 000	EUR	670 464	663 628	0,17
Unipol Gruppo SpA 4.375% 14 - 03.05.21	500 000	EUR	511 436	508 498	0,13
UnipolSai Assicurazioni SpA 3.875% 18 - 03.01.28	750 000	EUR	741 397	737 827	0,18
Vittoria Assicurazioni SpA 5.75% 18 - 07.11.28	350 000	EUR	377 293	372 224	0,09
Webuild SpA 1.75% 17 - 26.10.24	750 000	EUR	671 559	656 151	0,16
Webuild SpA 3.625% 20 - 28.01.27	325 000	EUR	311 262	274 648	0,07
Webuild SpA 3.75% 16 - 24.06.21	700 000	EUR	701 824	696 510	0,17
			62 351 133	61 910 712	15,47
Japon					
SoftBank Group Corp. 3.125% 17 - 19.09.25	1 600 000	EUR	1 559 435	1 521 371	0,38
SoftBank Group Corp. 4.00% 15 - 30.07.22	400 000	EUR	403 448	408 333	0,10
SoftBank Group Corp. 4.00% 18 - 20.04.23	1 400 000	EUR	1 447 692	1 412 135	0,35
SoftBank Group Corp. 4.50% 18 - 20.04.25	600 000	EUR	614 709	611 500	0,15

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Japon (suite)					
SoftBank Group Corp. 4.75% 15 - 30.07.25	950 000	EUR	995 481	979 295	0,25
SoftBank Group Corp. 5.00% 18 - 15.04.28	1 700 000	EUR	1 757 983	1 760 518	0,44
			6 778 748	6 693 152	1,67
Jersey					
Adient Global Holdings Ltd. 3.50% 16 - 15.08.24	1 400 000	EUR	1 202 575	1 236 783	0,31
Avis Budget Finance PLC 4.125% 16 - 15.11.24	400 000	EUR	380 360	315 421	0,08
Avis Budget Finance PLC 4.50% 17 - 15.05.25	400 000	EUR	310 607	308 698	0,08
Avis Budget Finance PLC 4.75% 18 - 30.01.26	480 000	EUR	492 715	366 878	0,09
Walnut Bidco PLC 6.75% 19 - 08.01.24	700 000	EUR	663 049	661 500	0,16
			3 049 306	2 889 280	0,72
Lituanie					
Maxima Grupe UAB 3.25% 18 - 13.09.23	500 000	EUR	512 488	494 661	0,12
			512 488	494 661	0,12
Luxembourg					
ADO Properties SA 1.50% 17 - 26.07.24	600 000	EUR	564 200	566 452	0,14
Altice Financing SA 2.25% 20 - 15.01.25	400 000	EUR	388 830	373 424	0,09
Altice Financing SA 2.25% 20 - 15.01.25	400 000	EUR	378 155	373 424	0,09
Altice Financing SA 3.00% 20 - 15.01.28	1 600 000	EUR	1 545 055	1 468 773	0,37
Altice Finco SA 4.75% 17 - 15.01.28	950 000	EUR	886 604	864 529	0,22
Altice France Holdings SA 4.00% 20 - 15.02.28	750 000	EUR	697 045	676 187	0,17
AnaCap Financial Europe SA SICAV-RAIF FRN 17 - 08.01.24	500 000	EUR	420 279	386 500	0,10
Aramark International Finance Sarl 3.125% 17 - 04.01.25	500 000	EUR	488 596	474 017	0,12
ArcelorMittal SA 0.95% 17 - 17.01.23	810 000	EUR	786 541	782 149	0,20
ArcelorMittal SA 1.00% 19 - 19.05.23	1 050 000	EUR	1 018 323	1 009 271	0,25
ArcelorMittal SA 1.75% 19 - 19.11.25	1 050 000	EUR	1 002 692	996 625	0,25
ArcelorMittal SA 2.25% 19 - 17.01.24	1 400 000	EUR	1 393 975	1 377 818	0,34
Arena Luxembourg Finance Sarl 1.875% 20 - 02.01.28	650 000	EUR	642 186	590 850	0,15
Cabot Financial Luxembourg II SA FRN 19 - 14.06.24	600 000	EUR	587 527	586 286	0,15
Cirsa Finance International Sarl FRN 19 - 30.09.25	776 000	EUR	723 475	641 124	0,16
Cirsa Finance International Sarl 4.75% 19 - 22.05.25	600 000	EUR	543 820	523 660	0,13
Cirsa Finance International Sarl 6.25% 18 - 20.12.23	900 000	EUR	867 160	814 500	0,20
ContourGlobal Power Holdings SA 3.375% 18 - 08.01.23	600 000	EUR	606 550	605 963	0,15
ContourGlobal Power Holdings SA 4.125% 18 - 08.01.25	600 000	EUR	606 084	614 100	0,15
Corestate Capital Holdings SA 3.50% 18 - 15.04.23	400 000	EUR	380 206	331 500	0,08
Crystal Almond SARL 4.25% 19 - 15.10.24	800 000	EUR	795 347	786 029	0,20
eDreams ODIGEO SA 5.50% 18 - 09.01.23	650 000	EUR	561 046	529 750	0,13
Fiat Chrysler Finance Europe SENC 4.75% 14 - 22.03.21	1 500 000	EUR	1 537 363	1 522 725	0,38
Fiat Chrysler Finance Europe SENC 4.75% 14 - 15.07.22	1 900 000	EUR	2 010 923	1 973 271	0,49
Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 17 - 09.01.23	600 000	EUR	522 379	512 670	0,13
Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 18 - 09.01.23	800 000	EUR	719 750	692 707	0,17
Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 15 - 08.01.22	500 000	EUR	447 135	467 847	0,12

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Luxembourg (suite)					
Gestamp Funding Luxembourg SA 3.50% 16 - 15.05.23	750 000	EUR	728 559	725 013	0,18
Groupe Ecore Holdings SAS FRN 18 - 15.11.23	350 000	EUR	308 094	218 313	0,05
Hanesbrands Finance Luxembourg SCA 3.50% 16 - 15.06.24	750 000	EUR	780 304	744 846	0,19
INEOS Group Holdings SA 5.375% 16 - 08.01.24	900 000	EUR	897 089	879 420	0,22
Intralot Capital Luxembourg SA 5.25% 17 - 15.09.24	650 000	EUR	415 260	141 897	0,04
Intralot Capital Luxembourg SA 6.75% 16 - 15.09.21	400 000	EUR	284 928	167 778	0,04
Lincoln Financing SARL 3.625% 19 - 04.01.24	1 750 000	EUR	1 707 214	1 594 495	0,40
Lincoln Financing SARL FRN 19 - 04.01.24	900 000	EUR	858 402	825 390	0,21
LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 18 - 15.03.24	400 000	EUR	377 772	391 000	0,10
Matterhorn Telecom SA 2.625% 19 - 15.09.24	400 000	EUR	392 248	389 169	0,10
Matterhorn Telecom SA 3.125% 19 - 15.09.26	850 000	EUR	850 010	816 874	0,20
Matterhorn Telecom SA 3.125% 19 - 15.09.26	100 000	EUR	95 378	96 103	0,02
Matterhorn Telecom SA 4.00% 17 - 15.11.27	600 000	EUR	611 161	602 108	0,15
Monitchem HoldCo 3 SA 5.25% 19 - 15.03.25	400 000	EUR	400 565	404 587	0,10
Motion Finco Sarl 7.00% 20 - 15.05.25	800 000	EUR	808 550	819 309	0,20
Mytilneos Financial Partners SA 2.50% 19 - 12.01.24	700 000	EUR	687 660	697 083	0,17
Picard Bondco SA 5.50% 17 - 30.11.24	400 000	EUR	381 206	396 697	0,10
Rossini Sarl FRN 19 - 30.10.25	950 000	EUR	924 684	929 261	0,23
Rossini Sarl 6.75% 18 - 30.10.25	850 000	EUR	901 301	904 283	0,23
Samsonite Finco Sarl 3.50% 18 - 15.05.26	550 000	EUR	495 419	475 915	0,12
SIG Combibloc PurchaseCo Sarl 1.875% 20 - 18.06.23	310 000	EUR	310 000	314 826	0,08
SIG Combibloc PurchaseCo Sarl 2.125% 20 - 18.06.25	240 000	EUR	240 000	243 943	0,06
Stena International SA 3.75% 20 - 02.01.25	500 000	EUR	474 760	463 375	0,12
Summer BC Holdco A Sarl 9.25% 19 - 31.10.27	630 737	EUR	594 679	540 374	0,14
Summer BC Holdco B SARL 5.75% 19 - 31.10.26	1 450 000	EUR	1 442 470	1 378 370	0,34
Swissport Financing Sarl 5.25% 19 - 15.08.24	550 000	EUR	525 741	454 438	0,11
Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 17 - 03.01.28	400 000	EUR	409 191	404 763	0,10
Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 17 - 03.01.28	400 000	EUR	409 373	404 763	0,10
Vivion Investments Sarl 3.00% 19 - 08.08.24	400 000	EUR	403 159	363 674	0,09
Vivion Investments Sarl 3.00% 19 - 08.08.24	600 000	EUR	567 774	545 511	0,14
Vivion Investments Sarl 3.50% 19 - 11.01.25	400 000	EUR	407 425	364 236	0,09
			39 811 622	38 239 965	9,55
Mexique					
Cemex SAB de CV 2.75% 17 - 12.05.24	900 000	EUR	876 870	826 798	0,21
Cemex SAB de CV 3.125% 19 - 19.03.26	600 000	EUR	582 169	544 642	0,13
Credito Real SAB de CV SOFOM ER 5.00% 19 - 02.01.27	500 000	EUR	488 562	413 449	0,10
Nemak SAB de CV 3.25% 17 - 15.03.24	750 000	EUR	711 092	708 312	0,18
			2 658 693	2 493 201	0,62
Pays-Bas					
Ashland Services BV 2.00% 20 - 30.01.28	750 000	EUR	722 261	693 445	0,17

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 16 - 15.01.25	700 000	EUR	694 603	689 360	0,17
CBR Fashion Finance BV 5.125% 17 - 10.01.22	600 000	EUR	548 262	511 960	0,13
Darling Global Finance BV 3.625% 18 - 15.05.26	700 000	EUR	707 452	703 496	0,18
Diamond BC BV 5.625% 17 - 15.08.25	700 000	EUR	624 441	662 731	0,17
Dtek Renewables Finance BV 8.50% 19 - 11.12.24	450 000	EUR	417 169	387 000	0,10
Dufry One BV 2.00% 19 - 15.02.27	1 050 000	EUR	984 462	815 785	0,20
Dufry One BV 2.50% 17 - 15.10.24	1 180 000	EUR	1 124 229	986 560	0,25
Energizer Gamma Acquisition BV 4.625% 18 - 15.07.26	900 000	EUR	909 186	917 852	0,23
Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 16 - 29.03.24	1 800 000	EUR	1 925 551	1 846 314	0,46
Frigoglass Finance BV 6.875% 20 - 02.12.25	350 000	EUR	324 615	238 875	0,06
Goodyear Europe BV 3.75% 15 - 15.12.23	300 000	EUR	282 319	287 578	0,07
Hema Bondco I BV FRN 17 - 15.07.22	850 000	EUR	636 771	542 111	0,14
Intertrust Group BV 3.375% 18 - 15.11.25	700 000	EUR	714 215	696 826	0,17
IPD 3 BV 4.50% 17 - 15.07.22	750 000	EUR	750 117	698 796	0,17
Kongsberg Actuation Systems BV 5.00% 18 - 15.07.25	400 000	EUR	345 563	293 500	0,07
LKQ European Holdings BV 3.625% 18 - 04.01.26	1 050 000	EUR	1 062 361	1 063 722	0,27
LKQ European Holdings BV 4.125% 18 - 04.01.28	400 000	EUR	406 929	415 529	0,10
Maxeda DIY Holding BV 6.125% 17 - 15.07.22	700 000	EUR	613 986	640 098	0,16
Metinvest BV 5.625% 19 - 17.06.25	400 000	EUR	375 058	360 815	0,09
OCI NV 3.125% 19 - 11.01.24	1 050 000	EUR	1 061 055	1 027 625	0,26
OCI NV 5.00% 18 - 15.04.23	500 000	EUR	504 019	502 578	0,13
OI European Group BV 2.875% 19 - 15.02.25	700 000	EUR	696 834	673 960	0,17
OI European Group BV 3.125% 16 - 15.11.24	1 050 000	EUR	1 073 767	1 032 035	0,26
Petrobras Global Finance BV 5.875% 11 - 03.07.22	500 000	EUR	536 401	522 521	0,13
PPF Telecom Group BV 2.125% 19 - 31.01.25	400 000	EUR	393 384	387 020	0,10
PPF Telecom Group BV 2.125% 19 - 31.01.25	500 000	EUR	497 286	483 776	0,12
PPF Telecom Group BV 3.125% 19 - 27.03.26	700 000	EUR	708 022	695 827	0,17
PPF Telecom Group BV 3.50% 20 - 20.05.24	700 000	EUR	710 529	712 542	0,18
Promontoria Holdings 264 BV FRN 18 - 15.08.23	400 000	EUR	319 138	317 200	0,08
Promontoria Holdings 264 BV 6.75% 18 - 15.08.23	550 000	EUR	489 984	437 938	0,11
Q-Park Holdings I BV 1.50% 20 - 03.01.25	550 000	EUR	532 650	508 874	0,13
Q-Park Holdings I BV FRN 20 - 03.01.26	500 000	EUR	485 396	469 661	0,12
Q-Park Holdings I BV 2.00% 20 - 03.01.27	950 000	EUR	925 195	877 390	0,22
Saipem Finance International BV 2.625% 17 - 01.07.25	750 000	EUR	741 737	742 080	0,19
Saipem Finance International BV 2.75% 17 - 04.05.22	800 000	EUR	808 287	802 442	0,20
Saipem Finance International BV 3.75% 16 - 09.08.23	700 000	EUR	739 334	717 157	0,18
Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV 1.80% 17 - 07.06.24	400 000	EUR	377 660	343 811	0,09
Schoeller Packaging BV 6.375% 19 - 11.01.24	400 000	EUR	397 121	380 000	0,09
Selecta Group BV FRN 18 - 02.01.24	550 000	EUR	413 687	199 925	0,05
Selecta Group BV 5.875% 18 - 02.01.24	1 200 000	EUR	1 127 505	429 769	0,11
Sigma Holdco BV 5.75% 18 - 15.05.26	1 000 000	EUR	969 255	971 187	0,24
Sunshine Mid BV 6.50% 18 - 15.05.26	500 000	EUR	500 265	493 349	0,12
Sunshine Mid BV 6.50% 18 - 15.05.26	100 000	EUR	101 855	98 670	0,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Pays-Bas (suite)					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 0.375% 16 - 25.07.20	1 369 058	EUR	1 366 847	1 360 834	0,34
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.125% 16 - 15.10.24	2 200 000	EUR	1 933 924	1 923 578	0,48
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 15 - 31.03.23	1 900 000	EUR	1 768 096	1 767 044	0,44
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 18 - 15.04.22	1 000 000	EUR	996 664	993 402	0,25
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 18 - 03.01.25	1 250 000	EUR	1 221 434	1 239 781	0,31
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 6.00% 19 - 31.01.25	1 500 000	EUR	1 555 511	1 580 952	0,40
Trivium Packaging Finance BV 3.75% 19 - 15.08.26	900 000	EUR	924 065	883 175	0,22
Trivium Packaging Finance BV FRN 19 - 15.08.26	550 000	EUR	550 840	529 426	0,13
United Group BV 3.125% 20 - 15.02.26	950 000	EUR	912 820	895 355	0,22
United Group BV FRN 20 - 15.02.26	600 000	EUR	569 162	569 653	0,14
United Group BV 3.625% 20 - 15.02.28	900 000	EUR	846 607	842 475	0,21
United Group BV FRN 19 - 15.05.25	700 000	EUR	686 785	684 828	0,17
United Group BV 4.875% 17 - 07.01.24	800 000	EUR	787 210	791 639	0,20
VZ Vendor Financing BV 2.50% 19 - 31.01.24	800 000	EUR	802 333	780 542	0,20
ZF Europe Finance BV 1.25% 19 - 23.10.23	700 000	EUR	640 333	660 478	0,16
ZF Europe Finance BV 2.00% 19 - 23.02.26	1 300 000	EUR	1 157 100	1 202 903	0,30
ZF Europe Finance BV 2.50% 19 - 23.10.27	900 000	EUR	808 722	818 483	0,20
ZF Europe Finance BV 3.00% 19 - 23.10.29	1 000 000	EUR	893 502	893 806	0,22
Ziggo Bond Co. BV 3.375% 20 - 28.02.30	1 350 000	EUR	1 302 640	1 268 825	0,32
Ziggo BV 2.875% 19 - 15.01.30	700 000	EUR	703 011	689 331	0,17
Ziggo BV 4.25% 16 - 15.01.27	990 000	EUR	1 037 656	1 019 046	0,25
			50 745 178	48 675 246	12,16
Panama					
Carnival Corp. 1.875% 15 - 11.07.22	800 000	EUR	648 281	586 731	0,15
			648 281	586 731	0,15
Portugal					
Caixa Geral de Depositos SA 1.25% 19 - 25.11.24	800 000	EUR	791 258	774 709	0,19
Transportes Aereos Portugueses SA 5.625% 19 - 12.02.24	500 000	EUR	459 941	335 938	0,09
			1 251 199	1 110 647	0,28
Roumanie					
RCS & RDS SA 2.50% 20 - 02.05.25	600 000	EUR	583 169	573 271	0,14
RCS & RDS SA 3.25% 20 - 02.05.28	600 000	EUR	569 641	562 069	0,14
			1 152 810	1 135 340	0,28
Espagne					
Banco de Sabadell SA 1.125% 19 - 27.03.25	700 000	EUR	668 072	634 341	0,16
Banco de Sabadell SA 1.75% 19 - 05.10.24	1 500 000	EUR	1 478 719	1 421 197	0,36
Banco de Sabadell SA 5.625% 16 - 05.06.26	300 000	EUR	346 321	307 312	0,08
Banco de Sabadell SA 5.625% 16 - 05.06.26	400 000	EUR	434 279	409 749	0,10
Bankia SA 1.00% 19 - 25.06.24	700 000	EUR	690 694	672 547	0,17
Bankia SA 1.125% 19 - 11.12.26	700 000	EUR	700 199	651 872	0,16
Bankia SA 1.125% 19 - 11.12.26	400 000	EUR	368 747	372 498	0,09

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Espagne (suite)					
Cellnex Telecom SA 1.00% 20 - 20.04.27	700 000	EUR	676 498	667 439	0,17
Cellnex Telecom SA 1.875% 20 - 26.06.29	300 000	EUR	297 235	295 503	0,07
Cellnex Telecom SA 2.375% 16 - 16.01.24	600 000	EUR	611 829	624 005	0,16
Cellnex Telecom SA 2.375% 16 - 16.01.24	500 000	EUR	520 430	520 004	0,13
Cellnex Telecom SA 2.875% 17 - 18.04.25	500 000	EUR	532 363	532 840	0,13
Cellnex Telecom SA 3.125% 15 - 27.07.22	200 000	EUR	206 931	210 065	0,05
Cellnex Telecom SA 3.125% 15 - 27.07.22	600 000	EUR	627 977	630 195	0,16
El Corte Ingles SA 3.00% 18 - 15.03.24	1 000 000	EUR	1 008 513	975 914	0,24
Foodco Bondco SL 6.25% 19 - 15.05.26	510 000	EUR	488 852	384 811	0,10
Gestamp Automocion SA 3.25% 18 - 30.04.26	550 000	EUR	525 698	522 642	0,13
Grifols SA 1.625% 19 - 15.02.25	1 300 000	EUR	1 306 625	1 265 928	0,32
Grifols SA 2.25% 19 - 15.11.27	1 100 000	EUR	1 104 258	1 079 119	0,27
Grifols SA 3.20% 17 - 05.01.25	1 400 000	EUR	1 408 090	1 393 860	0,35
Grupo Antolin-Irausa SA 3.25% 17 - 30.04.24	600 000	EUR	508 962	523 963	0,13
Grupo Antolin-Irausa SA 3.375% 18 - 30.04.26	330 000	EUR	306 733	276 818	0,07
Haya Finance 2017 SA 5.25% 17 - 15.11.22	400 000	EUR	347 334	313 000	0,08
International Consolidated Airlines Group SA 0.50% 19 - 07.04.23	800 000	EUR	664 089	634 590	0,16
International Consolidated Airlines Group SA 1.50% 19 - 07.04.27	700 000	EUR	554 647	524 831	0,13
Naviera Armas SA FRN 17 - 15.11.24	400 000	EUR	297 689	215 333	0,05
Naviera Armas SA FRN 16 - 31.07.23	400 000	EUR	308 219	219 804	0,05
NH Hotel Group SA 3.75% 16 - 10.01.23	539 524	EUR	520 248	483 150	0,12
Obrascon Huarte Lain SA 4.75% 14 - 15.03.22	500 000	EUR	371 925	270 583	0,07
Obrascon Huarte Lain SA 5.50% 15 - 15.03.23	400 000	EUR	310 020	211 850	0,05
Tendam Brands SAU FRN 17 - 15.09.24	450 000	EUR	420 769	386 499	0,10
			18 612 965	17 632 262	4,41
Supranationales					
Ardagh Packaging Finance PLC Via Ardagh Holdings USA Inc. 2.125% 19 - 15.08.26	700 000	EUR	696 365	672 483	0,17
Ardagh Packaging Finance PLC Via Ardagh Holdings USA Inc. 2.125% 20 - 15.08.26	220 000	EUR	212 371	211 352	0,05
Eagle Intermediate Global Holdings BV Via Ruyi US Finance LLC 5.375% 18 - 05.01.23	350 000	EUR	288 395	228 948	0,06
Garrett LX I Sarl Via Garrett Borrowing LLC 5.125% 18 - 15.10.26	550 000	EUR	456 386	449 721	0,11
Starfruit Finco BV Via Starfruit US Holdco LLC 6.50% 18 - 10.01.26	750 000	EUR	738 710	756 328	0,19
			2 392 227	2 318 832	0,58
Suède					
Assemblin Financing AB FRN 19 - 15.05.25	300 000	EUR	286 043	281 018	0,07
Dometic Group AB 3.00% 18 - 13.09.23	450 000	EUR	453 162	441 000	0,11
Dometic Group AB 3.00% 19 - 05.08.26	400 000	EUR	381 652	376 743	0,09
Intrum AB 2.75% 17 - 15.07.22	1 075 000	EUR	1 052 299	1 019 960	0,25
Intrum AB 3.00% 19 - 15.09.27	1 200 000	EUR	1 089 937	1 001 080	0,25
Intrum AB 3.125% 17 - 15.07.24	1 300 000	EUR	1 223 675	1 172 789	0,29
Intrum AB 3.50% 19 - 15.07.26	1 200 000	EUR	1 166 540	1 051 020	0,26
Polygon AB 4.00% 18 - 23.02.23	400 000	EUR	365 977	396 000	0,10

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Suède (suite)					
Radisson Hotel Holdings AB 6.875% 18 - 15.07.23	350 000	EUR	352 010	333 812	0,08
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 0.875% 17 - 03.01.21	700 000	EUR	700 005	700 137	0,18
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.875% 17 - 03.01.24	700 000	EUR	722 930	716 818	0,18
Unilabs Subholding AB 5.75% 17 - 15.05.25	550 000	EUR	550 250	541 887	0,14
Verisure Holdings AB 3.50% 18 - 15.05.23	650 000	EUR	659 415	650 006	0,16
Verisure Midholding AB 5.75% 17 - 12.01.23	1 550 000	EUR	1 538 639	1 551 569	0,39
Volvo Car AB 2.00% 17 - 24.01.25	750 000	EUR	734 707	725 620	0,18
Volvo Car AB 2.125% 19 - 04.02.24	850 000	EUR	847 450	831 918	0,21
Volvo Car AB 3.25% 16 - 18.05.21	300 000	EUR	307 846	304 130	0,08
Volvo Car AB 3.25% 16 - 18.05.21	350 000	EUR	354 805	354 818	0,09
			12 787 342	12 450 325	3,11
Turquie					
Arcelik AS 3.875% 14 - 16.09.21	500 000	EUR	506 808	504 196	0,13
			506 808	504 196	0,13
Royaume-Uni					
Algeco Global Finance PLC 6.50% 18 - 15.02.23	1 000 000	EUR	960 459	958 463	0,24
Arrow Global Finance PLC FRN 17 - 04.01.25	650 000	EUR	619 538	586 203	0,15
Arrow Global Finance PLC FRN 18 - 03.01.26	400 000	EUR	386 861	361 444	0,09
Boparan Finance PLC 4.375% 14 - 15.07.21	410 000	EUR	338 310	372 331	0,09
Carnival PLC 1.00% 19 - 28.10.29	900 000	EUR	569 811	468 140	0,12
EC Finance PLC 2.375% 17 - 15.11.22	700 000	EUR	697 538	634 279	0,16
eG Global Finance PLC 3.625% 19 - 02.07.24	400 000	EUR	369 980	380 761	0,09
eG Global Finance PLC 4.375% 19 - 02.07.25	1 020 000	EUR	971 453	936 634	0,23
eG Global Finance PLC 6.25% 19 - 30.10.25	600 000	EUR	591 285	582 170	0,15
eG Global Finance PLC 6.25% 19 - 30.10.25	400 000	EUR	400 555	388 113	0,10
Ellaktor Value PLC 6.375% 19 - 15.12.24	1 010 000	EUR	922 255	842 796	0,21
FCE Bank PLC 1.615% 16 - 05.11.23	1 100 000	EUR	1 001 556	1 031 250	0,26
INEOS Finance PLC 2.125% 17 - 15.11.25	750 000	EUR	736 547	711 085	0,18
INEOS Finance PLC 2.875% 19 - 05.01.26	350 000	EUR	351 312	333 074	0,08
INEOS Finance PLC 2.875% 19 - 05.01.26	750 000	EUR	728 507	713 731	0,18
International Game Technology PLC 2.375% 19 - 15.04.28	750 000	EUR	692 253	671 414	0,17
International Game Technology PLC 3.50% 18 - 15.07.24	700 000	EUR	698 734	675 962	0,17
International Game Technology PLC 3.50% 19 - 15.06.26	1 050 000	EUR	1 048 172	990 351	0,25
International Game Technology PLC 4.75% 15 - 15.02.23	1 200 000	EUR	1 211 988	1 207 000	0,30
International Personal Finance PLC 5.75% 14 - 04.07.21	600 000	EUR	515 500	517 500	0,13
Jaguar Land Rover Automotive PLC 2.20% 17 - 15.01.24	950 000	EUR	789 369	770 102	0,19
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4.50% 18 - 15.01.26	700 000	EUR	644 250	552 193	0,14
Jaguar Land Rover Automotive PLC 5.875% 19 - 15.11.24	750 000	EUR	713 088	644 367	0,16

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
Royaume-Uni (suite)					
Jaguar Land Rover Automotive PLC 6.875% 19 - 15.11.26	450 000	EUR	440 684	381 817	0,09
Jaguar Land Rover Automotive PLC 6.875% 19 - 15.11.26	200 000	EUR	177 209	169 696	0,04
Nomad Foods Bondco PLC 3.25% 17 - 15.05.24	550 000	EUR	551 556	552 764	0,14
OTE PLC 3.50% 14 - 07.09.20	900 000	EUR	900 476	899 778	0,22
Synlab Bondco PLC FRN 20 - 07.01.25	1 200 000	EUR	1 200 062	1 197 718	0,30
Synlab Unsecured Bondco PLC 8.25% 15 - 07.01.23	300 000	EUR	302 498	307 009	0,08
Synlab Unsecured Bondco PLC 8.25% 15 - 07.01.23	200 000	EUR	208 448	204 672	0,05
Synthomer PLC 3.875% 20 - 07.01.25	280 000	EUR	280 000	283 186	0,07
Titan Global Finance PLC 2.375% 17 - 16.11.24	550 000	EUR	532 987	547 525	0,14
Titan Global Finance PLC 3.50% 16 - 17.06.21	400 000	EUR	406 871	404 555	0,10
Victoria PLC 5.25% 19 - 15.07.24	700 000	EUR	649 418	658 335	0,16
Viridian Group FinanceCo PLC Via Viridian Power & Energy 4.00% 17 - 15.09.25	450 000	EUR	447 528	435 854	0,11
			22 057 058	21 372 272	5,34
États-Unis					
Avantor Inc. 4.75% 17 - 10.01.24	750 000	EUR	770 045	770 849	0,19
Axalta Coating Systems LLC 4.25% 16 - 15.08.24	450 000	EUR	452 311	445 570	0,11
Ball Corp. 0.875% 19 - 15.03.24	1 050 000	EUR	1 039 679	1 006 514	0,25
Ball Corp. 1.50% 19 - 15.03.27	450 000	EUR	441 659	429 876	0,11
Ball Corp. 1.50% 19 - 15.03.27	350 000	EUR	342 438	334 348	0,08
Ball Corp. 4.375% 15 - 15.12.23	1 000 000	EUR	1 096 360	1 080 531	0,27
Banff Merger Sub Inc. 8.375% 18 - 09.01.26	400 000	EUR	387 571	399 505	0,10
Belden Inc. 2.875% 17 - 15.09.25	400 000	EUR	384 466	376 180	0,09
Belden Inc. 3.375% 17 - 15.07.27	700 000	EUR	685 616	673 808	0,17
Belden Inc. 3.875% 18 - 15.03.28	500 000	EUR	506 878	485 938	0,12
Berry Global Inc. 1.00% 20 - 15.01.25	620 000	EUR	616 909	585 020	0,15
Berry Global Inc. 1.00% 20 - 15.01.25	430 000	EUR	412 236	405 740	0,10
Berry Global Inc. 1.50% 20 - 15.01.27	500 000	EUR	484 680	471 241	0,12
Carlson Travel Inc. FRN 16 - 15.06.23	500 000	EUR	436 362	301 364	0,07
Catalent Pharma Solutions Inc. 2.375% 20 - 03.01.28	1 200 000	EUR	1 130 707	1 136 367	0,28
Cemex Finance LLC 4.625% 16 - 15.06.24	600 000	EUR	599 892	591 902	0,15
CGG Holdings US Inc. 7.875% 18 - 05.01.23	350 000	EUR	356 790	353 391	0,09
Chemours Co. 4.00% 18 - 15.05.26	660 000	EUR	575 906	589 875	0,15
Colfax Corp. 3.25% 17 - 15.05.25	500 000	EUR	498 788	496 033	0,12
Coty Inc. 4.00% 18 - 15.04.23	800 000	EUR	768 824	709 087	0,18
Coty Inc. 4.75% 18 - 15.04.26	320 000	EUR	316 644	278 961	0,07
Ford Motor Credit Co. LLC FRN 18 - 12.07.22	1 000 000	EUR	863 267	904 374	0,23
Ford Motor Credit Co. LLC FRN 17 - 12.01.24	800 000	EUR	629 950	668 401	0,17
Ford Motor Credit Co. LLC FRN 18 - 15.11.23	600 000	EUR	490 868	514 988	0,13
Ford Motor Credit Co. LLC 1.355% 18 - 02.07.25	700 000	EUR	581 380	600 918	0,15
Ford Motor Credit Co. LLC 1.514% 19 - 17.02.23	1 400 000	EUR	1 264 842	1 309 364	0,33
Ford Motor Credit Co. LLC 1.744% 20 - 19.07.24	1 300 000	EUR	1 112 190	1 168 771	0,29
Ford Motor Credit Co. LLC 2.33% 19 - 25.11.25	900 000	EUR	752 395	789 971	0,20
Ford Motor Credit Co. LLC 2.386% 19 - 17.02.26	1 100 000	EUR	910 270	964 896	0,24
Ford Motor Credit Co. LLC 3.021% 19 - 03.06.24	1 700 000	EUR	1 527 871	1 623 075	0,40
IQVIA Inc. 2.25% 19 - 15.01.28	1 000 000	EUR	1 011 341	958 965	0,24

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
IQVIA Inc. 2.875% 17 - 15.09.25	600 000	EUR	604 133	601 763	0,15
IQVIA Inc. 2.875% 20 - 15.06.28	570 000	EUR	570 000	565 739	0,14
IQVIA Inc. 3.25% 17 - 15.03.25	2 000 000	EUR	2 017 707	2 014 040	0,50
IQVIA Inc. 3.50% 16 - 15.10.24	850 000	EUR	859 495	863 699	0,22
Iron Mountain Inc. 3.00% 17 - 15.01.25	400 000	EUR	392 070	390 839	0,10
Kraft Heinz Foods Co. 1.50% 16 - 24.05.24	800 000	EUR	801 943	789 479	0,20
Kraft Heinz Foods Co. 2.00% 15 - 30.06.23	1 100 000	EUR	1 127 118	1 112 262	0,28
Kraton Polymers LLC Via Kraton Polymers Capital Corp. 5.25% 18 - 15.05.26	400 000	EUR	376 789	402 000	0,10
Kronos International Inc. 3.75% 17 - 15.09.25	550 000	EUR	539 113	535 576	0,13
Levi Strauss & Co. 3.375% 17 - 15.03.27	700 000	EUR	713 331	704 110	0,18
Mauser Packaging Solutions Holdings Co. 4.75% 18 - 15.04.24	700 000	EUR	682 038	679 375	0,17
MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 3.325% 17 - 24.03.25	650 000	EUR	685 036	688 540	0,17
MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 4.00% 15 - 19.08.22	800 000	EUR	837 887	833 750	0,21
Netflix Inc. 3.00% 20 - 15.06.25	700 000	EUR	708 615	719 708	0,18
Netflix Inc. 3.625% 17 - 15.05.27	1 800 000	EUR	1 871 908	1 872 000	0,47
Refinitiv US Holdings Inc. 4.50% 18 - 15.05.26	1 200 000	EUR	1 248 097	1 248 593	0,31
Refinitiv US Holdings Inc. 6.875% 18 - 15.11.26	500 000	EUR	527 310	530 422	0,13
Scientific Games International Inc. 3.375% 18 - 15.02.26	450 000	EUR	422 767	412 369	0,10
Scientific Games International Inc. 5.50% 18 - 15.02.26	350 000	EUR	317 055	279 533	0,07
Sealed Air Corp. 4.50% 15 - 15.09.23	200 000	EUR	216 199	212 502	0,05
Sealed Air Corp. 4.50% 15 - 15.09.23	400 000	EUR	432 990	425 005	0,11
Silgan Holdings Inc. 2.25% 20 - 06.01.28	700 000	EUR	691 465	671 117	0,17
Silgan Holdings Inc. 3.25% 18 - 15.03.25	850 000	EUR	856 089	853 315	0,21
Spectrum Brands Inc. 4.00% 16 - 10.01.26	600 000	EUR	604 792	586 418	0,15
Standard Industries Inc. 2.25% 19 - 21.11.26	1 100 000	EUR	1 044 240	1 030 792	0,26
Superior Industries International Inc. 6.00% 17 - 15.06.25	400 000	EUR	325 500	325 760	0,08
Tenneco Inc. 4.875% 17 - 15.04.22	550 000	EUR	520 850	519 554	0,13
Tenneco Inc. FRN 17 - 15.04.24	450 000	EUR	427 540	398 360	0,10
Tenneco Inc. 5.00% 17 - 15.07.24	450 000	EUR	416 737	409 442	0,10
UGI International LLC 3.25% 18 - 11.01.25	500 000	EUR	506 998	487 438	0,12
WMG Acquisition Corp. 2.75% 20 - 15.07.28	220 000	EUR	220 000	223 037	0,05
WMG Acquisition Corp. 3.625% 18 - 15.10.26	650 000	EUR	672 750	671 439	0,17
ZF North America Capital Inc. 2.75% 15 - 27.04.23	1 600 000	EUR	1 535 810	1 588 231	0,40
			45 223 507	45 072 030	11,26
Total - Obligations			400 105 553	389 609 567	97,35
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			400 105 553	389 609 567	97,35

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire^(A)					
Obligations					
Luxembourg					
Altice France Holdings SA 8.00% 20 - 15.05.27	1 900 000	EUR	1 938 066	2 001 078	0,50
			1 938 066	2 001 078	0,50
Supranationales					
Clarios Global LP Via Clarios US Finance Co. 4.375% 19 - 15.05.26	1 000 000	EUR	988 470	986 600	0,25
			988 470	986 600	0,25
Total - Obligations			2 926 536	2 987 678	0,75
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			2 926 536	2 987 678	0,75
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			403 032 089	392 597 245	98,10
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				397 195 905	99,25

^(A) Si des titres apparaissent plusieurs fois ici sous le même nom, ils sont cotés à des bourses différentes ou ont des ISIN différents.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Autriche					
Austria 2.10% 17 - 20.09.17	1 200 000	EUR	2 079 012	2 365 235	1,17
			2 079 012	2 365 235	1,17
Belgique					
Belgium Zero Coupon 98 - 28.03.21	4 100 000	EUR	4 112 675	4 116 400	2,04
			4 112 675	4 116 400	2,04
Canada					
Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15 - 15.05.23	1 700 000	EUR	1 721 760	1 687 250	0,84
			1 721 760	1 687 250	0,84
Danemark					
DKT Finance ApS 7.00% 18 - 17.06.23	1 200 000	EUR	1 290 000	1 193 220	0,59
TDC A/S 5.00% 12 - 03.02.22	300 000	EUR	328 548	312 180	0,16
			1 618 548	1 505 400	0,75
Finlande					
Nokia OYJ 2.00% 17 - 15.03.24	100 000	EUR	101 804	101 613	0,05
Nokia OYJ 2.00% 19 - 03.11.26	1 000 000	EUR	996 050	990 970	0,49
Teollisuuden Voima OYJ 2.125% 15 - 02.04.25	1 461 000	EUR	1 416 879	1 441 349	0,72
Teollisuuden Voima OYJ 2.50% 14 - 17.03.21	800 000	EUR	809 862	807 608	0,40
			3 324 595	3 341 540	1,66
France					
APRR SA 1.50% 15 - 15.01.24	600 000	EUR	636 481	622 345	0,31
Casino Guichard Perrachon SA 1.865% 17 - 13.06.22	1 200 000	EUR	1 127 627	1 153 800	0,57
Casino Guichard Perrachon SA 4.498% 14 - 03.07.24	500 000	EUR	463 006	450 455	0,22
Casino Guichard Perrachon SA 4.561% 13 - 25.01.23	300 000	EUR	287 067	287 307	0,14
CMA CGM SA 5.25% 17 - 15.01.25	200 000	EUR	178 689	165 994	0,08
CMA CGM SA 7.75% 15 - 15.01.21	1 100 000	EUR	1 008 737	1 089 440	0,54
Constellium SE 4.25% 17 - 15.02.26	200 000	EUR	196 920	196 002	0,10
Elis SA 1.875% 18 - 15.02.23	200 000	EUR	207 316	195 130	0,10
Europcar Mobility Group 4.125% 17 - 15.11.24	375 000	EUR	366 214	288 049	0,14
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.24	1 900 000	EUR	1 896 873	1 939 938	0,96
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.25	1 800 000	EUR	1 836 678	1 843 578	0,91
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.28	9 500 000	EUR	9 583 460	9 697 980	4,81
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.30	7 800 000	EUR	7 752 885	7 888 062	3,91
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.31	6 700 000	EUR	6 637 568	6 745 560	3,35
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.32	3 200 000	EUR	3 127 971	3 179 616	1,58
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.38	3 100 000	EUR	2 829 423	2 915 240	1,45
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.39	3 800 000	EUR	3 248 177	3 536 546	1,75
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.29	1 900 000	EUR	1 912 932	1 933 269	0,96
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.33	3 400 000	EUR	3 290 319	3 353 828	1,66
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.35	300 000	EUR	283 276	290 373	0,14
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.37	3 400 000	EUR	3 130 274	3 223 676	1,60
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.39	3 500 000	EUR	3 138 145	3 250 975	1,61
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	2 700 000	EUR	4 823 982	4 964 486	2,46
Louvre Bidco SAS FRN 18 - 30.09.24	300 000	EUR	303 900	290 463	0,14
Orano SA 3.125% 14 - 20.03.23	300 000	EUR	302 120	303 405	0,15
Orano SA 3.25% 13 - 09.04.20	2 000 000	EUR	2 076 430	2 007 140	1,00
Renault SA 1.00% 17 - 03.08.23	1 247 000	EUR	1 183 345	1 191 072	0,59

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Rexel SA 2.75% 19 - 15.06.26	700 000	EUR	731 500	694 050	0,34
Tereos Finance Groupe I SA 4.125% 16 - 16.06.23	600 000	EUR	425 922	516 846	0,26
			62 987 237	64 214 625	31,83
Allemagne					
ADLER Real Estate AG 1.875% 18 - 27.04.23	2 000 000	EUR	1 984 840	1 936 880	0,96
ADLER Real Estate AG 2.125% 17 - 02.06.24	200 000	EUR	201 572	193 100	0,10
ADLER Real Estate AG 3.00% 18 - 27.04.26	500 000	EUR	505 682	495 425	0,24
Bundesrepublik Deutschland Principal Strips Zero Coupon 00 - 01.04.31	15 300 000	EUR	15 947 418	15 967 998	7,92
K+S AG 2.625% 17 - 04.06.23	100 000	EUR	102 665	88 824	0,04
METRO AG 1.125% 18 - 03.06.23	2 600 000	EUR	2 480 669	2 546 966	1,26
METRO AG 1.375% 14 - 28.10.21	200 000	EUR	202 963	199 098	0,10
METRO AG 1.50% 15 - 19.03.25	100 000	EUR	95 488	98 078	0,05
thyssenkrupp AG 1.375% 17 - 03.03.22	1 700 000	EUR	1 702 936	1 653 420	0,82
thyssenkrupp AG 1.875% 19 - 03.06.23	1 600 000	EUR	1 499 504	1 537 552	0,76
			24 723 737	24 717 341	12,25
Irlande					
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.375% 17 - 02.01.24	1 300 000	EUR	1 339 130	1 326 325	0,66
Willow No 2 Ireland PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 3.375% 12 - 27.06.22	800 000	EUR	865 312	849 129	0,42
			2 204 442	2 175 454	1,08
Italie					
Atlantia SpA 1.625% 17 - 02.03.25	250 000	EUR	239 546	234 920	0,12
Banco BPM SpA 2.00% 19 - 03.08.22	1 000 000	EUR	1 005 433	1 005 510	0,50
Banco BPM SpA 2.75% 15 - 27.07.20	800 000	EUR	801 377	801 072	0,40
Banco BPM SpA 7.125% 11 - 03.01.21	250 000	EUR	265 788	255 485	0,13
Iccrea Banca SpA FRN 18 - 02.01.21	1 600 000	EUR	1 590 131	1 593 792	0,79
Intesa Sanpaolo SpA 2.855% 15 - 23.04.25	900 000	EUR	925 173	915 858	0,45
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.21	1 500 000	EUR	1 501 418	1 499 520	0,74
Leonardo SpA 1.50% 17 - 06.07.24	400 000	EUR	388 826	397 232	0,20
Leonardo SpA 4.50% 13 - 19.01.21	1 000 000	EUR	1 022 262	1 018 460	0,51
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 5.00% 10 - 15.11.20	1 500 000	EUR	1 581 285	1 521 240	0,75
Telecom Italia SpA 2.375% 17 - 10.12.27	144 000	EUR	134 914	140 401	0,07
Telecom Italia SpA 2.50% 17 - 19.07.23	150 000	EUR	151 530	152 867	0,08
Telecom Italia SpA 2.75% 19 - 15.04.25	600 000	EUR	611 752	602 940	0,30
Telecom Italia SpA 3.25% 15 - 16.01.23	600 000	EUR	634 247	624 054	0,31
Telecom Italia SpA 3.625% 16 - 19.01.24	1 600 000	EUR	1 638 569	1 663 856	0,82
Unipol Gruppo SpA 3.00% 15 - 18.03.25	500 000	EUR	496 845	510 755	0,25
Unipol Gruppo SpA 3.50% 17 - 29.11.27	500 000	EUR	479 636	511 425	0,25
Webuild SpA 3.75% 16 - 24.06.21	200 000	EUR	186 551	199 876	0,10
			13 655 283	13 649 263	6,77
Japon					
SoftBank Group Corp. 3.125% 17 - 19.09.25	1 450 000	EUR	1 540 610	1 377 877	0,68
SoftBank Group Corp. 4.75% 15 - 30.07.25	600 000	EUR	655 614	618 900	0,31
			2 196 224	1 996 777	0,99

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Luxembourg					
Fiat Chrysler Finance Europe SENC 4.75% 14 - 22.03.21	600 000	EUR	644 318	609 750	0,30
Fiat Chrysler Finance Europe SENC 4.75% 14 - 15.07.22	1 655 000	EUR	1 754 982	1 721 200	0,85
Votorantim Cimentos International SA 3.50% 15 - 13.07.22	1 000 000	EUR	1 001 600	1 008 960	0,50
			3 400 900	3 339 910	1,65
Pays-Bas					
Daimler International Finance BV 0.20% 17 - 13.09.21	850 000	EUR	852 684	848 327	0,42
Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 16 - 29.03.24	950 000	EUR	1 036 985	977 997	0,49
Saipem Finance International BV 2.625% 17 - 01.07.25	1 200 000	EUR	1 190 113	1 190 028	0,59
Saipem Finance International BV 3.75% 16 - 09.08.23	200 000	EUR	207 234	204 908	0,10
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 0.375% 16 - 25.07.20	2 174 064	EUR	2 172 889	2 164 215	1,07
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.125% 16 - 15.10.24	950 000	EUR	760 276	832 932	0,41
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 15 - 31.03.23	1 400 000	EUR	1 319 045	1 300 334	0,64
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 18 - 03.01.25	200 000	EUR	189 494	198 606	0,10
			7 728 720	7 717 347	3,82
Espagne					
Banco de Sabadell SA FRN 17 - 31.12.99	1 000 000	EUR	1 023 930	818 880	0,41
Cellnex Telecom SA 2.375% 16 - 16.01.24	1 900 000	EUR	2 030 967	1 977 482	0,98
Grifols SA 3.20% 17 - 05.01.25	1 100 000	EUR	1 127 061	1 097 756	0,54
Spain 3.45% 16 - 30.07.66	800 000	EUR	1 295 648	1 316 544	0,65
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 01 - 30.07.24	600 000	EUR	605 546	603 696	0,30
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.10.20	1 200 000	EUR	1 201 521	1 201 776	0,60
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.10.21	800 000	EUR	804 169	804 160	0,40
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 13 - 31.10.24	3 100 000	EUR	3 092 619	3 113 144	1,54
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 15 - 30.07.22	600 000	EUR	601 880	604 056	0,30
Spain Government Bond Coupon Strip Zero Coupon 15 - 30.07.24	1 700 000	EUR	1 679 641	1 708 602	0,85
			13 462 982	13 246 096	6,57
Suède					
Dometic Group AB 3.00% 19 - 05.08.26	600 000	EUR	620 790	566 424	0,28
Intrum AB 2.75% 17 - 15.07.22	325 000	EUR	330 106	308 929	0,15
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.875% 17 - 03.01.24	1 100 000	EUR	1 117 468	1 127 687	0,56
Telia Co. AB FRN 17 - 04.04.78	1 047 000	EUR	1 069 860	1 065 085	0,53
Unilabs Subholding AB 5.75% 17 - 15.05.25	400 000	EUR	415 040	396 000	0,20

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Suède (suite)					
Verisure Midholding AB 5.75% 17 - 12.01.23	1 800 000	EUR	1 856 268	1 804 626	0,90
Volvo Car AB 2.00% 17 - 24.01.25	1 400 000	EUR	1 368 156	1 357 314	0,67
Volvo Car AB 2.125% 19 - 04.02.24	500 000	EUR	516 194	490 000	0,24
			7 293 882	7 116 065	3,53
Royaume-Uni					
International Game Technology PLC 4.75% 15 - 15.02.23	200 000	EUR	216 780	201 606	0,10
			216 780	201 606	0,10
États-Unis					
Avantor Inc. 4.75% 17 - 10.01.24	500 000	EUR	528 720	515 000	0,26
Ball Corp. 4.375% 15 - 15.12.23	1 000 000	EUR	1 146 210	1 082 500	0,54
Banff Merger Sub Inc. 8.375% 18 - 09.01.26	300 000	EUR	283 581	299 700	0,15
Belden Inc. 3.375% 17 - 15.07.27	1 250 000	EUR	1 274 575	1 206 625	0,60
Colfax Corp. 3.25% 17 - 15.05.25	400 000	EUR	409 269	397 948	0,20
Equinix Inc. 2.875% 17 - 10.01.25	382 000	EUR	397 253	388 204	0,19
Huntsman International LLC 4.25% 16 - 04.01.25	1 000 000	EUR	1 057 144	1 056 364	0,52
IQVIA Inc. 3.25% 17 - 15.03.25	2 700 000	EUR	2 760 696	2 720 250	1,35
MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 4.00% 15 - 19.08.22	200 000	EUR	215 398	208 686	0,10
Netflix Inc. 3.625% 17 - 15.05.27	1 400 000	EUR	1 480 654	1 458 058	0,72
			9 553 500	9 333 335	4,63
Total - Obligations			160 280 277	160 723 644	79,68
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			160 280 277	160 723 644	79,68
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations					
Italie					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 11.01.20	2 100 000	EUR	2 102 015	2 101 764	1,04
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.22	1 600 000	EUR	1 596 138	1 594 672	0,79
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.24	2 900 000	EUR	2 863 468	2 835 620	1,41
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.25	2 000 000	EUR	1 952 834	1 927 840	0,96
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.26	1 400 000	EUR	1 347 970	1 329 104	0,66
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 05.01.28	2 000 000	EUR	1 862 025	1 818 220	0,90
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 98 - 11.01.28	1 600 000	EUR	1 481 978	1 442 832	0,71

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé					
Obligations (suite)					
Italie (suite)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 00 - 05.01.30	3 600 000	EUR	3 224 481	3 138 588	1,56
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.23	900 000	EUR	867 172	893 043	0,44
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.25	1 600 000	EUR	1 558 807	1 538 112	0,76
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.26	3 100 000	EUR	2 996 309	2 943 481	1,46
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.26	2 900 000	EUR	2 783 551	2 729 799	1,35
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.27	2 500 000	EUR	2 385 827	2 335 550	1,16
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 02.01.28	2 000 000	EUR	1 875 716	1 831 000	0,91
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.28	2 100 000	EUR	1 950 806	1 902 138	0,94
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 02 - 08.01.29	1 800 000	EUR	1 637 523	1 593 306	0,79
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 10 - 09.01.24	1 700 000	EUR	1 661 720	1 653 114	0,82
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 12 - 09.01.22	1 400 000	EUR	1 400 527	1 396 220	0,69
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro Zero Coupon 13 - 09.01.30	3 300 000	EUR	2 739 417	2 798 631	1,39
			38 288 284	37 803 034	18,74
Total - Obligations			38 288 284	37 803 034	18,74
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			38 288 284	37 803 034	18,74
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			198 568 561	198 526 678	98,42
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				199 378 825	98,85

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Chine					
China 1.99% 20 - 04.09.25	10 000 000	CNY	1 411 801	1 378 361	2,09
China 2.85% 20 - 06.04.27	20 000 000	CNY	2 821 365	2 827 646	4,30
China 2.94% 19 - 17.10.24	50 000 000	CNY	7 163 612	7 198 363	10,94
China 3.12% 19 - 12.05.26	60 000 000	CNY	8 710 460	8 619 018	13,11
China 3.22% 18 - 12.06.25	130 000 000	CNY	19 032 082	18 842 525	28,65
China 3.25% 19 - 06.06.26	130 000 000	CNY	18 784 650	18 853 227	28,67
China 3.60% 18 - 09.06.25	20 000 000	CNY	2 909 495	2 964 210	4,51
China 3.61% 18 - 06.07.25	10 000 000	CNY	1 533 244	1 485 026	2,26
China 3.77% 18 - 03.08.25	10 000 000	CNY	1 566 156	1 498 170	2,28
			63 932 865	63 666 546	96,81
Total - Obligations			63 932 865	63 666 546	96,81
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			63 932 865	63 666 546	96,81
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			63 932 865	63 666 546	96,81
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				64 457 434	98,02

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations					
Australie					
CNOOC Curtis Funding No 1 Pty Ltd. 4.50% 13 - 10.03.23	200 000	USD	212 424	218 988	1,02
			212 424	218 988	1,02
Îles Vierges britanniques					
China Cinda Finance 2015 I Ltd. 4.25% 15 - 23.04.25	200 000	USD	211 453	218 921	1,02
China Cinda Finance 2017 I Ltd. 4.75% 18 - 02.08.28	200 000	USD	198 800	229 023	1,07
China Reinsurance Finance Corp. Ltd. 3.375% 17 - 03.09.22	200 000	USD	200 382	201 120	0,94
China Southern Power Grid International Finance BVI Co. Ltd. 3.50% 17 - 05.08.27	200 000	USD	216 648	217 860	1,02
CNOOC Finance 2013 Ltd. 2.875% 19 - 30.09.29	200 000	USD	199 983	212 088	0,99
CNOOC Finance 2013 Ltd. 3.00% 13 - 05.09.23	200 000	USD	197 454	208 492	0,97
Coastal Emerald Ltd. FRN 19 - 31.12.99	200 000	USD	204 230	199 660	0,93
COSCO Finance 2011 Ltd. 4.00% 12 - 12.03.22	200 000	USD	204 633	209 658	0,98
COSL Finance BVI Ltd. 3.25% 12 - 09.06.22	200 000	USD	200 173	206 199	0,96
Elect Global Investments Ltd. FRN 20 - 31.12.99	200 000	USD	193 294	192 369	0,90
Guohui International Bvi Co. Ltd. 4.37% 19 - 07.09.22	270 000	USD	266 390	271 766	1,27
Hongkong Electric Finance Ltd. 2.875% 16 - 05.03.26	200 000	USD	200 132	211 359	0,99
Huarong Finance 2017 Co. Ltd. 4.25% 17 - 11.07.27	200 000	USD	193 639	209 471	0,98
Huarong Finance 2017 Co. Ltd. FRN 17 - 31.12.99	200 000	USD	194 819	201 268	0,94
Huarong Finance 2019 Co. Ltd. 3.75% 19 - 29.05.24	200 000	USD	199 645	205 103	0,96
Huarong Finance II Co. Ltd. 3.625% 16 - 22.11.21	200 000	USD	199 840	202 209	0,94
Huarong Finance II Co. Ltd. 4.625% 16 - 06.03.26	200 000	USD	215 721	214 103	1,00
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd. 3.90% 12 - 17.05.22	200 000	USD	203 513	209 096	0,97
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd. 4.875% 12 - 17.05.42	200 000	USD	215 972	257 777	1,20
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd. 3.00% 17 - 04.12.22	200 000	USD	200 334	205 589	0,96
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd. 3.25% 17 - 13.09.27	200 000	USD	209 193	214 735	1,00
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd. 3.625% 17 - 04.12.27	200 000	USD	217 593	218 803	1,02
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd. 2.50% 19 - 08.08.24	200 000	USD	199 997	207 252	0,97
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd. 2.70% 20 - 13.05.30	200 000	USD	205 835	205 897	0,96
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd. 3.75% 18 - 09.12.23	200 000	USD	199 069	214 226	1,00
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd. 4.125% 14 - 05.07.24	200 000	USD	205 224	219 470	1,02
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd. 3.50% 17 - 05.04.27	200 000	USD	210 217	220 789	1,03
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd. 4.25% 18 - 05.02.28	200 000	USD	201 660	233 867	1,09
Talent Yield Investments Ltd. 4.50% 12 - 25.04.22	200 000	USD	200 618	208 195	0,97
			5 966 461	6 226 365	29,05

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Canada					
CNOOC Finance 2014 ULC 4.25% 14 - 30.04.24	200 000	USD	206 804	220 148	1,03
			206 804	220 148	1,03
Îles Caïmans					
Alibaba Group Holding Ltd. 4.40% 17 - 12.06.57	200 000	USD	208 326	257 148	1,20
Alibaba Group Holdings Ltd. 3.40% 17 - 12.06.27	300 000	USD	312 433	333 396	1,56
Alibaba Group Holdings Ltd. 3.60% 15 - 28.11.24	300 000	USD	317 226	326 864	1,53
Azure Nova International Finance Ltd. 2.625% 16 - 11.01.21	200 000	USD	198 227	201 832	0,94
Azure Orbit IV International Finance Ltd. 3.75% 18 - 25.01.23	200 000	USD	204 142	208 101	0,97
Baidu Inc. 3.50% 12 - 28.11.22	200 000	USD	202 702	208 633	0,97
Baidu Inc. 3.875% 18 - 29.09.23	200 000	USD	201 212	212 670	0,99
China Overseas Finance Cayman VII Ltd. 4.75% 18 - 26.04.28	200 000	USD	223 628	231 132	1,08
CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd. FRN 17 - 31.12.99	200 000	USD	199 515	200 169	0,93
CK Hutchison International 19 Ltd. 3.625% 19 - 04.11.29	220 000	USD	232 625	243 994	1,14
Country Garden Holdings Co. Ltd. 7.25% 19 - 04.08.26	200 000	USD	219 615	218 000	1,02
Hutchison Whampoa International 03 Via 33 Ltd. 7.45% 03 - 24.11.33	110 000	USD	148 140	169 697	0,79
Hutchison Whampoa International 11 Ltd. 4.625% 12 - 13.01.22	200 000	USD	206 077	209 415	0,98
Shimao Property Holdings Ltd. 6.125% 19 - 21.02.24	200 000	USD	209 048	210 993	0,99
Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd. 4.50% 12 - 14.02.22	200 000	USD	203 751	208 297	0,97
Tencent Holdings Ltd. 3.595% 18 - 19.01.28	200 000	USD	208 340	217 306	1,01
Tencent Holdings Ltd. 3.925% 18 - 19.01.38	200 000	USD	197 487	225 604	1,05
Tencent Holdings Ltd. 3.975% 19 - 04.11.29	300 000	USD	324 985	337 400	1,57
			4 017 479	4 220 651	19,69
Chine					
Bank of China Ltd. 5.00% 14 - 13.11.24	300 000	USD	312 321	333 962	1,56
China Construction Bank Corp. FRN 19 - 27.02.29	270 000	USD	270 498	288 216	1,34
China Minmetals Corp. FRN 17 - 31.12.99	200 000	USD	195 147	201 394	0,94
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 4.875% 15 - 21.09.25	250 000	USD	263 467	282 049	1,32
			1 041 433	1 105 621	5,16
Hong Kong					
AIA Group Ltd. 3.375% 20 - 04.07.30	200 000	USD	216 250	218 052	1,02
AIA Group Ltd. 3.60% 19 - 04.09.29	200 000	USD	201 125	219 466	1,02
Bank of China Hong Kong Ltd. FRN 18 - 31.12.99	220 000	USD	229 291	234 081	1,09
CITIC Ltd. 3.70% 16 - 14.06.26	200 000	USD	202 350	218 241	1,02
CMB International Leasing Management Ltd. 3.00% 19 - 07.03.24	200 000	USD	203 260	204 601	0,95
CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 3.875% 19 - 19.06.29	200 000	USD	200 518	216 219	1,01
CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 4.875% 18 - 14.03.25	200 000	USD	213 805	221 978	1,04
CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 5.125% 18 - 14.03.28	200 000	USD	218 570	231 309	1,08

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Hong Kong (suite)					
ICBCIL Finance Co. Ltd. 3.375% 17 - 04.05.22	200 000	USD	197 942	204 733	0,95
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3.975% 17 - 11.09.27	200 000	USD	199 023	212 347	0,99
Weichai International Hong Kong Energy Group Co. Ltd. FRN 17 - 31.12.99	200 000	USD	196 637	196 560	0,92
			2 278 771	2 377 587	11,09
Inde					
Adani Electricity Mumbai Ltd. 3.949% 20 - 02.12.30	200 000	USD	201 547	186 268	0,87
Indian Oil Corp. Ltd. 4.75% 19 - 16.01.24	200 000	USD	206 848	209 851	0,98
Reliance Industries Ltd. 3.667% 17 - 30.11.27	450 000	USD	449 862	481 664	2,25
State Bank of India 3.25% 17 - 24.01.22	200 000	USD	198 746	202 914	0,94
			1 057 003	1 080 697	5,04
Indonésie					
Bank Mandiri Persero Tbk PT 3.75% 19 - 04.11.24	200 000	USD	203 570	204 137	0,95
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 20 - 15.05.25	200 000	USD	208 462	213 977	1,00
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.53% 18 - 15.11.28	270 000	USD	276 773	319 959	1,49
Pertamina Persero PT 3.65% 19 - 30.07.29	200 000	USD	207 239	209 005	0,98
Pertamina Persero PT 4.175% 20 - 21.01.50	200 000	USD	200 000	200 041	0,93
Pertamina Persero PT 4.30% 13 - 20.05.23	350 000	USD	353 604	369 034	1,72
Pertamina Persero PT 4.875% 12 - 05.03.22	200 000	USD	208 857	209 395	0,98
Pertamina Persero PT 5.625% 13 - 20.05.43	200 000	USD	201 942	231 317	1,08
Pertamina Persero PT 6.00% 12 - 05.03.42	200 000	USD	234 096	238 681	1,11
Perusahaan Gas Negara Persero 5.125% 14 - 16.05.24	200 000	USD	201 972	208 986	0,98
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.50% 11 - 22.11.21	200 000	USD	205 472	208 796	0,98
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6.15% 18 - 21.05.48	200 000	USD	206 748	249 249	1,16
			2 708 735	2 862 577	13,36
Île de Man					
Gohl Capital Ltd. 4.25% 17 - 24.01.27	200 000	USD	201 898	201 353	0,94
			201 898	201 353	0,94
Corée					
Hanwha Life Insurance Co. Ltd. FRN 18 - 23.04.48	200 000	USD	193 337	200 600	0,94
			193 337	200 600	0,94
Malaisie					
Petronas Capital Ltd. 3.50% 20 - 21.04.30	220 000	USD	229 764	244 020	1,14
Petronas Capital Ltd. 4.50% 15 - 18.03.45	200 000	USD	213 953	247 968	1,15
Petronas Capital Ltd. 4.80% 20 - 21.04.60	200 000	USD	234 500	273 742	1,28
			678 217	765 730	3,57
Pays-Bas					
Bharti Airtel International Netherlands BV 5.35% 14 - 20.05.24	200 000	USD	206 974	212 705	0,99
			206 974	212 705	0,99
Philippines					
Philippine National Bank 3.28% 19 - 27.09.24	200 000	USD	200 000	203 267	0,95
			200 000	203 267	0,95

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 30 juin 2020

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût d'acquisition	Valeur de marché	% de l'Actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Obligations (suite)					
Singapour					
BOC Aviation Ltd. 3.50% 19 - 10.10.24	200 000	USD	205 253	206 688	0,97
DBS Group Holdings Ltd. 2.85% 19 - 16.04.22	200 000	USD	203 296	206 304	0,96
			408 549	412 992	1,93
Royaume-Uni					
ST Engineering RHQ Ltd. 1.50% 20 - 29.04.25	260 000	USD	264 106	264 472	1,23
			264 106	264 472	1,23
États-Unis					
CNOOC Finance 2015 USA LLC 3.50% 15 - 05.05.25	300 000	USD	298 623	326 454	1,52
			298 623	326 454	1,52
Total - Obligations			19 940 814	20 900 207	97,51
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			19 940 814	20 900 207	97,51
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			19 940 814	20 900 207	97,51
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				21 075 736	98,33

Les notes jointes font partie intégrante de ces États Financiers.

Xtrackers II

Notes aux États Financiers

1. Généralités

a) La Société

Xtrackers II (la « Société ») est immatriculée au Grand-Duché de Luxembourg en qualité d'organisme de placement collectif en vertu de la Partie I de la Loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010 concernant les organismes de placement collectif, telle que modifiée (la « Loi »).

La Société est une société d'investissement de droit luxembourgeois constituée sous la forme d'une société d'investissement à capital variable (« SICAV ») sous le nom de « db x-trackers II » le 7 février 2007 pour une période indéterminée. Elle a été renommée « Xtrackers II » le 16 février 2018. Le capital minimum requis par la loi luxembourgeoise est de 1 250 000 euros.

Les Statuts ont été déposés auprès du Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg au Luxembourg (le « *Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg* ») et ont été publiés auprès du Mémorial du Grand-Duché de Luxembourg (le « *Mémorial* ») le 1^{er} mars 2007. La dernière modification en date des Statuts a été effectuée au cours d'une assemblée générale extraordinaire des Actionnaires qui s'est tenue le 6 mai 2020 et le procès-verbal de cette assemblée a été publié au *Recueil Électronique des Sociétés et Associations (Luxembourg)* (le « *RESA* ») le 11 mai 2020. La Société est immatriculée auprès du Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le numéro B-124.284.

La Société est actuellement constituée sous la forme d'un fonds à compartiments multiples afin d'offrir aux investisseurs, tant institutionnels que particuliers, un éventail de compartiments (les « *Compartiments* » ou, individuellement un « *Compartiment* ») dont la performance peut être liée en tout ou partie à la performance d'un actif sous-jacent tel que, par exemple, un panier de titres ou un indice.

Au 30 juin 2020, tous les Compartiments de la Société sont des compartiments négociés en bourse (*exchange traded funds*, « *ETF* »).

Au 30 juin 2020, la Société comprenait 38 Compartiments actifs :

Compartiment	Date de lancement
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	22 mai 2007
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	25 mai 2007
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	25 mai 2007
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	25 mai 2007
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	30 mai 2007
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	30 mai 2007
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	1 juin 2007
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	5 juin 2007
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	8 juin 2007
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	8 juin 2007
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	16 juillet 2007
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	16 juillet 2007
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	10 octobre 2007
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	10 octobre 2007
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	10 octobre 2007
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	7 novembre 2007
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	6 mai 2008
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	6 mai 2008
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	20 octobre 2008
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	7 juillet 2009
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	7 juillet 2009
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	5 janvier 2010
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	5 janvier 2010
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	23 février 2010
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	11 mai 2010
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	19 mai 2010
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	22 septembre 2010
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	22 septembre 2010
Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	18 octobre 2010
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	12 janvier 2012
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	27 novembre 2012
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	14 août 2013

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

1. Généralités (suite)

a) La Société (suite)

Compartiment	Date de lancement
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	15 novembre 2013
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	6 mars 2014
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	8 janvier 2015
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	8 janvier 2015
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	8 juillet 2015
Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF	2 septembre 2016

Les engagements des Compartiments sont comptabilisés séparément, les tierces parties créancières ne pouvant avoir de recours que sur la base des actifs propres du Compartiment concerné.

Événements significatifs de la période :

1. Le 10 janvier 2020, la Société a informé les Actionnaires d'une mise à jour du Prospectus pour décrire plus en détail le fonctionnement des compartiments à Réplication directe. La mise à jour clarifiait le fait que les compartiments suivant une méthode de Réplication totale de l'Indice pouvaient ne pas inclure tous les composants de l'indice concerné, et par conséquent, que ces compartiments pouvaient détenir d'autres valeurs mobilières ou d'autres actifs éligibles à titre ponctuel par opposition à une base exceptionnelle. La notification expliquait également que certains compartiments qui suivent respectivement une méthode à Réplication totale de l'Indice ou une méthode à Réplication optimisée de l'Indice seraient redésignés. Ces modifications ont pris effet le 12 février 2020.
2. Le 10 janvier 2020, la Société a informé les Actionnaires qu'à compter du 12 février 2020, DWS Investment GmbH, agissant en tant que Gestionnaire d'Investissement de la Société pour les Compartiments à Réplication directe, avait pour intention d'étendre le fonctionnement opérationnel de la délégation pour y inclure DWS Investments Hong Kong Limited, de manière à ce que le Gestionnaire d'Investissement puisse ponctuellement et conformément à une procédure préalablement convenue, déléguer certaines de ses fonctions de gestion de portefeuille concernant les Compartiments à Réplication directe à DWS Investments UK Limited et/ou à DWS Investments Hong Kong Limited.
3. Lors d'une assemblée générale des Actionnaires extraordinaire convoquée, qui s'est tenue le 6 mai 2020, il a été décidé de modifier l'article 21 des Statuts afin de prévoir la possibilité pour le Conseil d'administration de décider le fractionnement ou le regroupement d'Actions de tout Compartiment ou de toute Catégorie d'Actions. La modification prend effet à compter du 7 mai 2020.
4. Durant l'assemblée générale annuelle des Actionnaires en date du 17 avril 2020, la proposition de résolution suivante n'a pas été adoptée : « 6. Nominations légales et rémunération ». Les administrateurs actuels de la Société restent en fonction et ont convoqué une assemblée générale des Actionnaires en date du 26 juin 2020 (l'« Assemblée générale ») aux fins de voter sur la nomination des administrateurs. Toutes les résolutions proposées à l'Assemblée générale ont été adoptées et Manooj Mistry, Philippe Ah-Sun, Alex McKenna et Freddy Brausch ont été réélus au Conseil d'administration. Thilo Wendenburg a été élu pour la première fois au Conseil d'administration. La rémunération d'un montant de 15 000 euros pour Freddy Brausch concernant la période écoulée depuis le 8 avril 2019 jusqu'à la prochaine assemblée générale annuelle (tenue le 17 avril 2020) a été approuvée par une majorité d'Actionnaires lors de l'assemblée générale annuelle en date du 8 avril 2019. Afin de faire correspondre l'approbation de la rémunération des administrateurs avec les lettres de nomination de Freddy Brausch et de Thilo Wendenburg, la rémunération pour la période du 17 avril 2020 jusqu'à l'assemblée générale annuelle des Actionnaires, durant laquelle les comptes annuels seront approuvés pour l'exercice clos le 31 décembre 2020 (l'« AGA de 2021 »), sera votée par les Actionnaires lors de l'AGA de 2021. En conséquence, aucune résolution concernant l'approbation de la rémunération des administrateurs n'a été proposée à l'Assemblée générale.
5. Manooj Mistry a démissionné de ses fonctions d'administrateur à compter du 30 juin 2020.
6. La propagation du coronavirus COVID-19 depuis janvier 2020 a provoqué une grave crise économique, dont les effets précis sur l'économie ainsi que sur chaque marché et secteur ne peuvent actuellement pas encore être estimés de manière fiable du fait d'une grande incertitude. Considérant ce qui précède, le Conseil d'administration, à la suite de discussions avec ses principaux prestataires de services, est confiant que les mesures prises et les plans de continuité de l'activité mis en place limiteront les risques opérationnels courants ou prévisibles et empêcheront la perturbation des activités des Compartiments. L'apparition et la progression de l'épidémie mondiale du virus ont cependant créé une situation dont les effets potentiels en 2020 sont incertains et ne peuvent pas être évalués de manière concluante au moment de la préparation du présent rapport. Le Conseil d'Administration s'assure que la Société de Gestion prend toutes les mesures jugées appropriées pour protéger au mieux possible les intérêts des investisseurs.

b) Objectifs et Politiques d'Investissement

Les Compartiments sont autorisés à atteindre leur Objectif d'Investissement au moyen d'une Politique d'Investissement Indirect et/ou d'une Politique d'Investissement Direct, telles que plus amplement décrites dans les paragraphes suivants.

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

1. Généralités (suite)

b) Objectifs et Politiques d'Investissement (suite)

Compartiments à Politique d'Investissement Indirect

Le nom des Compartiments dotés d'une Politique d'Investissement Indirect comprend le mot « SWAP ». Les Compartiments à Politique d'Investissement Indirecte (les « Compartiments à Réplication indirecte ») ne peuvent pas investir directement dans les composants de l'Indice de Référence. Au lieu de cela, l'exposition à la performance de l'Indice de Référence sera obtenue grâce au recours à des transactions et/ou instruments dérivés (les « Transactions sur des instruments dérivés »). En particulier, un Compartiment à Réplication indirecte conclura des Opérations de Swap négociées de gré à gré dans des conditions normales de marché avec au moins une Contrepartie de Swap (la/les « Convention(s) de Swap négociée(s) de gré à gré »). Afin d'éviter toute ambiguïté, les Opérations de Swap négociées de gré à gré seraient considérées comme de Swap de Rendement Total au sens du règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil du 25 novembre 2015 relatif à la transparence des opérations de financement de titres et de leur réutilisation et modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 (le « Règlement SFTR »). La Politique d'Investissement Indirect ne prévoit actuellement pas la possibilité de conclure des accords de Prêt de Titres, des opérations d'achat avec revente ou de vente avec rachat, des opérations de prêt sur marge ou de mise en pension (et/ou des opérations de prise en pension), comme le prévoit le Règlement SFTR.

Pour atteindre son Objectif d'Investissement et dans le respect des Restrictions d'Investissement, un Compartiment à Réplication indirecte peut à tout moment investir une partie ou l'ensemble du produit net de ses émissions d'Actions :

- (a) dans des Actifs Investis et utiliser une ou plusieurs Transactions sur des instruments dérivés dont l'objet consiste à échanger tout ou partie de la performance et/ou du revenu desdits Actifs Investis pour s'exposer à l'Indice de Référence (un « Swap Non Financé ») (voir la Note 4) ; et/ou
- (b) dans une ou plusieurs Transactions sur des instruments dérivés dont l'objet consiste à échanger tout ou partie des produits investis pour s'exposer à l'Indice de référence (un « Swap Financé »).

Sauf mention contraire dans l'Annexe Produit correspondante, les Actifs Investis qui peuvent faire l'objet d'un Swap Non Financé sont des titres à revenu fixe éligibles OPCVM.

Pour les Swaps Financés, la proportion maximale de la Valeur Liquidative qui fait l'objet de Transactions sur des instruments dérivés est de 110 %, à l'exclusion de l'incidence des frais et opérations de couverture de change (« FX »), selon le cas ; tandis que la proportion prévue de la Valeur Liquidative qui fait l'objet de Transactions sur des instruments dérivés est de 100 % de la Valeur Liquidative, à l'exclusion de l'incidence des frais et des opérations de couverture de change, selon le cas.

Pour les Swaps Non Financés, la proportion maximale de la Valeur Liquidative qui fait l'objet de Transactions sur des instruments dérivés par rapport à l'Indice de Référence est de 110 %, à l'exclusion de l'incidence des frais et des opérations de couverture du risque de change, selon le cas ; tandis que la proportion prévue de la Valeur Liquidative qui fait l'objet de Transactions sur des instruments dérivés par rapport à l'Indice de Référence est de 100 %, à l'exclusion de l'incidence des frais et des instruments de couverture du risque de change, selon le cas.

Pour les Swaps Non Financés, la proportion maximale et prévue de la Valeur Liquidative qui fait l'objet de Transactions sur des instruments dérivés par rapport aux Actifs Investis est la même proportion que celle de la valeur des Actifs Investis par rapport à la Valeur Liquidative du Compartiment concerné.

Les Compartiments à Réplication indirecte peuvent, dans le respect des intérêts de leurs Actionnaires et sous réserve des dispositions de chaque Annexe Produit spécifique, décider de passer en tout ou en partie d'un Swap Financé à un Swap Non Financé, et inversement.

Les Actifs Investis, les Transactions sur des instruments dérivés et toutes les techniques employées pour lier les Actifs Investis à l'Indice de Référence ou les Transactions sur des instruments dérivés, ou le produit investi à l'Indice de Référence, sont gérés par le Gestionnaire d'Investissement et/ou le Gestionnaire de Portefeuille Délégué concerné. En règle générale, la gestion des Actifs Investis n'implique pas de politique active d'achat ou de vente de titres sur la base d'un jugement des Investissements et d'une analyse économique, financière et du marché.

En principe, le rendement que l'Actionnaire reçoit dépend en grande partie de la performance des Actifs Investis, de la performance de l'Indice de Référence et de la performance des techniques employées pour lier les Actifs Investis et/ou le produit net de l'émission d'Actions à l'Indice de Référence.

Selon la valeur des Transactions sur des instruments dérivés et de la politique choisie, les Compartiments à Réplication indirecte peuvent à tout moment être exposés, en totalité ou en partie, à une ou plusieurs contreparties (y compris une ou plusieurs Contreparties de Swap), auquel cas il convient de souscrire à une garantie adaptée ou de prendre d'autres dispositions (conformes aux Réglementations et EMIR) destinées à atténuer le risque de contrepartie, et/ou un paiement sera reçu des contreparties des Transactions sur des instruments dérivés de telle manière que le pourcentage d'exposition au risque de contrepartie reste dans les limites fixées par les Réglementations (voir Note 9).

Compartiments à Politique d'Investissement Direct

Les Compartiments ayant une Politique d'Investissement Direct (les « Compartiments à Réplication directe ») peuvent poursuivre leur objectif d'investissement en investissant dans un portefeuille de valeurs mobilières ou d'autres actifs éligibles qui peuvent comprendre :

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

1. Généralités (suite)

b) Objectifs et Politiques d'Investissement (suite)

(i) l'ensemble ou une partie importante des composants de l'Indice de Référence (ce type de compartiment étant dénommé « Compartiment à Réplication totale »), ou

(ii) un échantillon optimisé des composants de l'Indice, ou des valeurs mobilières non liées ou d'autres actifs éligibles (ce type de compartiment étant dénommé « Compartiment à Réplication optimisée »).

Les Compartiments à Réplication optimisée peuvent ne pas détenir tous les composants de l'Indice de Référence ou une pondération identique à tous ces composants. Il visera néanmoins à fournir un rendement similaire à celui de l'Indice de Référence : (i) en investissant dans des sous-ensembles de composants de l'Indice de Référence, (ii) en recherchant une exposition à l'Indice de Référence en utilisant des techniques d'optimisation et/ou (iii) en investissant dans des titres ne faisant pas partie de l'Indice de Référence. L'emploi de ces techniques d'investissement, dont la mise en œuvre est soumise à un certain nombre de contraintes, lesquelles sont détaillées dans la section « Restrictions d'Investissement » du Prospectus, peut ne pas produire les résultats escomptés.

Les Compartiments à Réplication totale peuvent parfois ne pas détenir tous les composants de l'Indice de Référence, et en conséquence, de tels Compartiments peuvent détenir d'autres valeurs mobilières ou d'autres actifs éligibles conformément aux Restrictions d'Investissement. La présence de tous les composants de l'Indice de Référence dans un Compartiment à Réplication totale variera et dépendra de nombreux facteurs dont, à titre non exhaustif, la nature et le nombre de composants de l'Indice de Référence (par exemple, lorsqu'un Indice de Référence comprend un grand nombre de titres, contient beaucoup de titres illiquides ou lorsque la disponibilité des composants pouvant être achetés est limitée), les restrictions juridiques et réglementaires, la taille du Compartiment, et l'utilisation de techniques de gestion de portefeuille efficace.

Une Politique d'Investissement Direct prévoit la possibilité de conclure des accords de Prêt de Titres, mais ne prévoit actuellement pas la possibilité de conclure des opérations de prêt sur marge ou de mise en pension (et/ou de prise en pension), des opérations d'achat avec revente ou de vente avec rachat ou de Swap de Rendement Total, tel que prévu par le Règlement SFTR. Si le Conseil d'administration décide de prévoir cette possibilité, le Prospectus sera mis à jour avant l'entrée en vigueur de cette décision afin que la Société respecte les obligations d'information applicables du Règlement SFTR pour ces Compartiments à Réplication directe.

Les types de titres dans lesquels les Compartiments à Réplication directe peuvent investir incluent les certificats de titre en dépôt américains (« ADR »), les certificats de titre en dépôt internationaux (« GDR ») et/ou les certificats de titre en dépôt sans droit de vote (« NVDR »). Les Compartiments à Réplication directe peuvent percevoir des revenus sur les titres qu'ils détiennent. Les revenus perçus sur les titres détenus par un Compartiment peuvent être imposables.

Les Compartiments à Réplication directe peuvent ponctuellement investir dans des soldes de trésorerie provisoires (tels que des produits de souscription en attente de placement ou tout autre solde de trésorerie provisoire) dans des IFD afin d'obtenir une exposition au marché et de chercher à réduire l'Écart de suivi.

En outre, le Gestionnaire d'Investissement se réserve le droit d'exclure de tout portefeuille du Compartiment les titres ne se conformant pas avec les politiques du Gestionnaire. Notamment, les titres ayant été identifiés comme impliqués dans la production ou la fabrication d'armes conventionnelles controversées, la production de dispositifs de distribution et la production délibérée, en toute connaissance de cause, de composants primaires clés d'armes conventionnelles controversées, chacun tel qu'étant déterminé par la DWS Controversial Conventional Weapons identification methodology.

Nonobstant ce qui précède, des circonstances exceptionnelles comme, entre autres, une perturbation des conditions de marché ou une volatilité extrême sur les marchés, peuvent survenir, engendrant une forte divergence du degré de précision de la réplication du Compartiment à Réplication directe par rapport à l'Indice de Référence.

c) Les Actions

Les Actions ne sont émises par la Société que relativement à des Compartiments appliquant les Politiques d'Investissement décrites dans le Prospectus, et leur souscription peut s'effectuer en numéraire ou en nature (ou une combinaison des deux).

Les Actions peuvent être réparties en Actions de distribution (identifiées par la lettre « D ») et en Actions de capitalisation (identifiées par la lettre « C »). D'autres Catégories présentant des caractéristiques spécifiques (notamment en matière de frais de conversion ou de rachat, de montant minimal de souscription, de critères d'éligibilité des investisseurs ou d'autres caractéristiques spécifiques) peuvent être offertes. Les Actions seront cotées sur au moins une bourse, sauf mention contraire dans l'Annexe Produit correspondante du Prospectus.

2. Principes comptables

Les États Financiers de la Société ont été établis conformément aux principes comptables généralement admis au Luxembourg et applicables aux compartiments d'investissement. Les grands principes comptables utilisés peuvent être détaillés comme suit :

a) Valorisation des Investissements

La Valeur Liquidative de la Société est, à tout moment, égale au total des Valeurs Liquidatives des Compartiments.

La Valeur Liquidative des Compartiments est déterminée conformément aux règles suivantes :

2. Principes comptables (suite)

a) Valorisation des Investissements (suite)

- (i) la valeur des liquidités en caisse ou en banque, des effets et des billets à vue, des effets à recevoir, des charges payées d'avance, des dividendes versés en numéraire et des intérêts déclarés ou courus et pas encore perçus sera réputée être leur valeur totale, sauf s'il est peu probable que ce montant soit payé ou perçu en totalité, auquel cas ladite valeur sera minorée d'une décote jugée appropriée afin de refléter, dans ce cas, la véritable valeur de ces instruments ;
- (ii) la valeur de tout titre coté ou négocié auprès d'une bourse de valeurs officielle ou négocié sur un autre Marché réglementé sera évaluée sur la base de son dernier cours de bourse publié le Jour ouvrable précédant immédiatement le Jour d'évaluation ou sur la base de son dernier cours offert à la bourse constituant le marché principal des Investissements des Compartiments. Le Conseil d'administration approuvera un service de fixation des prix pour fournir les prix susmentionnés. Si, suivant l'avis du Conseil d'administration, ces valeurs ne reflètent pas la juste valeur de marché des titres concernés, leur valeur sera déterminée de bonne foi par le Conseil d'administration en faisant référence à une source publique ou à toute autre source qu'il jugera, à sa libre appréciation, appropriée ;
- (iii) les titres ni cotés ni négociés auprès d'une bourse de valeurs officielle ou sur un Marché Réglementé seront évalués sur la base du prix de vente probable déterminé prudemment et de bonne foi par le Conseil d'administration ;
- (iv) les titres émis par des fonds d'investissement à capital variable sont évalués à leur dernière Valeur Liquidative disponible ou conformément à l'article (ii) ci-dessus lorsque ces titres sont cotés ;
- (v) la valeur de liquidation des contrats à terme ferme (« futures »), des contrats de change à terme ou des contrats d'options qui ne sont pas négociés sur des bourses de valeurs officielles ou d'autres marchés organisés est calculée conformément aux politiques définies par le Conseil d'administration, de façon constante. La valeur de liquidation des contrats à terme ferme (« futures »), des contrats de change à terme ou des options négociés sur des bourses de valeurs ou marchés organisés est fondée sur les derniers prix de règlement disponibles desdits contrats sur les bourses de valeur et marchés organisés où les contrats en question sont négociés, sous réserve que si un contrat à terme ferme (« futures »), un contrat de change à terme ou une option ne peut pas être liquidé le Jour ouvrable auquel est calculée la Valeur Liquidative, la base de calcul de ladite Valeur Liquidative du contrat en question correspond à la valeur estimée juste et raisonnable par le Conseil d'administration. La plus-value / (moins-value) nette réalisée sur les opérations de change est publiée dans les États financiers sous la rubrique « Plus-value / (moins-value) nette réalisée sur les opérations de change » ;
- (vi) les actifs liquides et instruments du marché monétaire peuvent être évalués à leur valeur nominale majorée de tout intérêt cumulé ou selon la méthode du coût amorti. Dans le cadre de cette dernière méthode, certaines périodes peuvent présenter une valeur qui diffère du prix que recevrait le Compartiment en question si l'Investissement était cédé. La Société de Gestion peut examiner cette méthode d'évaluation en tant que de besoin et recommander des modifications, le cas échéant, pour garantir que les actifs en question sont estimés à leur juste valeur, telle que déterminée de bonne foi suivant les procédures établies par le Conseil d'administration. Si le Conseil d'administration pense qu'un écart par rapport au coût amorti par Action peut entraîner une dilution considérable ou tout autre résultat défavorable pour les Actionnaires, il peut prendre la mesure correctrice qu'il juge adaptée, le cas échéant, pour éliminer ou réduire, dans la mesure du possible, la dilution ou le résultat défavorable ;
- (vii) les transactions sur Swaps de Rendement Total (« TRS ») sont déterminées sur la base d'un calcul de la valeur nette actualisée de leurs flux de trésorerie escomptés. Les Swaps de Rendement Total sont évalués à la valeur du marché à chaque Date de Valeur Liquidative ;
- (viii) tous les autres titres et tous les autres actifs autorisés, ainsi que tous les actifs susmentionnés pour lesquels l'évaluation conformément aux paragraphes ci-dessus ne serait pas possible ou réalisable ou ne serait pas représentative de leur juste valeur, seront évalués à leur juste valeur de marché, telle que déterminée de bonne foi suivant les procédures établies par le Conseil d'administration.

b) Opérations d'investissement

La plus-value / (moins-value) nette réalisée sur la cession d'investissements est déterminée sur la base du coût moyen des Investissements vendus. Les opérations d'investissement sont comptabilisées le jour de leur réalisation.

La plus-value / (moins-value) nette réalisée sur la cession d'investissements est publiée dans les États financiers sous la rubrique « Plus / (moins-value) nette réalisée sur Investissements ».

Le coût des obligations liées à l'inflation est ajusté pour prendre en compte l'inflation et ces ajustements sont comptabilisés en intérêts sur obligations.

c) Conversion des devises étrangères

Les enregistrements comptables sont conservés pour chaque Compartiment dans sa devise de référence. L'État de l'Actif net combiné et l'État des opérations et des variations de l'Actif net de la Société sont exprimés en euros sur la base du taux de change en vigueur à la date de l'État de l'Actif net.

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

2. Principes comptables (suite)

c) Conversion des devises étrangères (suite)

Les recettes et dépenses en devises autres que la devise de référence d'un Compartiment sont converties dans cette dernière au taux de change en vigueur à la date de la transaction.

Les éléments d'actifs et d'engagements en devises autres que la devise de référence d'un Compartiment sont convertis dans cette dernière au taux de change en vigueur à la date de l'État de l'Actif net.

Le prix d'achat des titres acquis dans des devises autres que la devise de référence du Compartiment est converti dans la devise de référence du Compartiment concerné au taux de change en vigueur à la date de l'achat des titres.

Les taux de change utilisés au 30 juin 2020 sont les suivants :

1 Euro = 1,631300 AUD	1 Euro = 121,171041 JPY
1 Euro = 1,529730 CAD	1 Euro = 10,835028 NOK
1 Euro = 1,064241 CHF	1 Euro = 1,744699 NZD
1 Euro = 7,945276 CNY	1 Euro = 10,463996 SEK
1 Euro = 7,453167 DKK	1 Euro = 1,566850 SGD
1 Euro = 0,908991 GBP	1 Euro = 1,123150 USD
1 Euro = 3,887166 ILS	

d) Revenus

Les intérêts sont enregistrés sur une base cumulée nette de retenue à la source et incluent l'amortissement linéaire des primes et de l'accroissement de l'écart d'actualisation qui sont divulgués dans les États financiers comme « Accroissement de l'écart d'actualisation ou Amortissement de la prime ». Les dividendes sont comptabilisés à la date de détachement, nets après déduction de la retenue à la source.

e) Valeur Liquidative

Le présent rapport semestriel est établi sur la base de la dernière Valeur Liquidative officielle des Compartiments disponible au 30 juin 2020.

3. Fiscalité de la Société

En vertu de la loi et des pratiques en vigueur actuellement, la Société n'est assujettie à aucun impôt sur le revenu, droit de timbre ou autre taxe du Luxembourg. Les éventuels revenus et plus-values perçus ou réalisés par la Société sur ses Investissements peuvent, toutefois, être soumis à l'impôt dans le pays d'origine à des taux variables ; et ces retenues ne peuvent généralement pas être recouvrées par la Société.

Bien que la Société soit, en principe, assujettie au Luxembourg à la Taxe d'Abonnement à un taux annuel de 0,05 % ou de 0,01 % pour les Catégories d'Actions réservées aux investisseurs institutionnels, tous les Compartiments qui sont des ETF répliqueurs d'indices sont exonérés de ladite taxe si (i) leurs Actions sont cotées ou négociées sur au moins une bourse de valeurs ou un autre marché réglementé opérant régulièrement, reconnu et ouvert au public ; et (ii) leur objectif exclusif est de refléter la performance d'un ou plusieurs indices, étant entendu que ladite condition d'objectif exclusif n'empêche pas la gestion accessoire des actifs liquides, le cas échéant, ou l'utilisation de techniques et instruments utilisés à des fins de couverture ou de gestion de portefeuille efficace. La réglementation luxembourgeoise peut imposer des critères supplémentaires ou différents aux indices concernés par cette exemption.

4. Swaps de Rendement Total

Les conventions de Swap de Rendement Total sont conclues au début de la durée de vie des Compartiments, les valeurs mobilières et les instruments du marché monétaire ayant un coût similaire à la valeur nominale de l'Indice de référence. Cette position peut cependant varier pendant la durée de vie du Swap, le coût des valeurs mobilières et des marchés monétaires, y compris les intérêts cumulés nets payés, pouvant devenir supérieur ou inférieur à la valeur nominale de l'indice de référence du fait des achats ou ventes complémentaires de valeurs mobilières et d'instruments du marché monétaire par rapport à la valeur nominale de l'indice.

La différence entre ces valeurs nominales est comptabilisée et constatée dans les États financiers à la rubrique intitulée « Produits à recevoir de la Contrepartie de Swap » ou « Montant à payer à la Contrepartie de Swap », en prenant en compte la valeur nominale la plus élevée. Les soldes à recevoir seront imputés au Compartiment et les soldes à payer seront réglés à la Contrepartie de Swap au moment de l'échéance des conventions de Swap respectives.

Le tableau ci-dessous reprend les valeurs nominales de l'actif investi et de l'actif sous-jacent du Swap et la plus-value / (moins-value) latente sur Swap pour chaque Compartiment au 30 juin 2020.

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

4. Swaps de Rendement Total (suite)

Compartiment	Actif sous-jacent	Devise	Valeur nominale - Actif investi	Valeur nominale - Actif sous-jacent	Produit à recevoir / (montant à payer) en provenance / (à destination) de la Contrepartie de Swap	Plus-value / (moins)-value latente sur Swap	Plus-value / (Moins-value) latente en % des Actifs nets
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	DEUTSCHE BANK EONIA TOTAL RETURN INDEX®	EUR	528 792 257	549 397 771	20 605 514	(14 975 321)	2,73 %
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® EUROPE 5-YEAR TOTAL RETURN INDEX	EUR	13 660 234	13 681 397	21 163	62 393	0,44 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® CROSSOVER 5-YEAR TOTAL RETURN INDEX	EUR	105 685 238	114 662 174	8 976 936	(6 036 925)	5,32 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® CROSSOVER 5-YEAR SHORT TOTAL RETURN INDEX	EUR	44 433 463	45 524 895	1 091 432	(1 147 874)	2,53 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	SHORT IBOXX® € SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX	EUR	44 085 652	49 403 017	5 317 365	(5 134 602)	12,01 %
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	IBOXX € GERMANY COVERED® INDEX	EUR	79 842 309	71 952 431	(7 889 878)	8 598 943	10,54 %
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	FED FUNDS EFFECTIVE RATE TOTAL RETURN INDEX®	USD	215 554 924	225 200 120	9 645 196	(6 633 102)	2,92 %
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	SONIA TOTAL RETURN INDEX®	GBP	94 978 846	101 406 339	6 427 493	(5 996 057)	5,87 %
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE AAA® INDEX	EUR	91 636 279	87 094 196	(4 542 083)	4 771 881	5,21 %
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	MTS ITALY BOT- EX-BANK OF ITALY® INDEX	EUR	118 058 203	116 052 117	(2 006 086)	3 369 982	2,90 %
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID COVERED INDEX®	EUR	8 420 780	8 474 799	54 019	44 115	0,50 %
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	BLOOMBERG BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND INDEX	USD	29 248 106	828 272 194	799 024 088	(789 211 969)	89,55 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID HIGH YIELD 1-3 INDEX	EUR	184 715 598	201 749 386	17 033 788	(14 661 986)	7,27 %

Comme l'exige le Règlement relatif aux Opérations de financement sur titres (voir Note 5), la Société a l'obligation de publier le montant des actifs Investis dans des Swap de Rendement Total sous la forme d'un montant absolu et d'une proportion de la Valeur Liquidative des Compartiments. Le pourcentage des Actifs nets publié dans le tableau ci-dessus est calculé sur la base de la Plus-value / (moins-value) latente sur Swap, en valeur absolue, divisée par la Valeur Liquidative totale. Ce montant n'est pas représentatif du calcul du risque de contrepartie.

Le tableau ci-dessous répertorie l'exposition aux actifs investis et à l'actif sous-jacent (indice) au 30 juin 2020.

Compartiment	Actif sous-jacent	Devise	Exposition - Actifs investis	Exposition - Actifs Investis en % des Actifs nets	Exposition - Actif sous-jacent	Exposition - Actif sous-jacent en % des Actifs nets
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	DEUTSCHE BANK EONIA TOTAL RETURN INDEX®	EUR	541 031 584	98,71 %	548 135 320	100,00 %
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® EUROPE 5-YEAR TOTAL RETURN INDEX	EUR	14 170 677	99,39 %	14 258 157	100,01 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® CROSSOVER 5-YEAR TOTAL RETURN INDEX	EUR	110 403 191	97,27 %	113 509 248	100,01 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® CROSSOVER 5-YEAR SHORT TOTAL RETURN INDEX	EUR	45 252 835	99,65 %	45 413 307	100,01 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	SHORT IBOXX® € SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX	EUR	42 585 547	99,57 %	42 778 767	100,02 %
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	IBOXX € GERMANY COVERED® INDEX	EUR	80 599 472	98,77 %	81 611 401	100,01 %

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

4. Swaps de Rendement Total (suite)

Compartiment	Actif sous-jacent	Devise	Exposition - Actifs investis	Exposition - Actifs Investis en % des Actifs nets	Exposition - Actif sous-jacent	Exposition - Actif sous-jacent en % des Actifs nets
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	FED FUNDS EFFECTIVE RATE TOTAL RETURN INDEX®	USD	223 643 749	98,31 %	227 508 519	100,01 %
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	SONIA TOTAL RETURN INDEX®	GBP	101 594 004	99,51 %	102 098 809	100,01 %
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE AAA® INDEX	EUR	91 406 391	99,77 %	91 636 187	100,02 %
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	MTS ITALY BOT- EX-BANK OF ITALY® INDEX	EUR	114 786 560	98,83 %	116 150 393	100,01 %
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID COVERED INDEX®	EUR	8 734 215	98,01 %	8 912 572	100,01 %
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	BLOOMBERG BARCLAYS GLOBAL AGGREGATE BOND INDEX	USD	868 176 046	98,51 %	881 585 260	100,04 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID HIGH YIELD 1-3 INDEX	EUR	198 526 678	98,42 %	201 756 792	100,03 %

Deutsche Bank AG est la Contrepartie aux conventions de Swap conclues par la Société.

Toutes les positions ouvertes à la fin de la période close le 30 juin 2020 ont été exécutées par règlement bilatéral.

Pour tous les Compartiments, il n'y a aucune échéance pour les conventions de Swap ci-dessus.

5. Opérations de financement sur titres

La Société est assujettie au Règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de réutilisation, ainsi qu'au règlement modificatif (UE) N° 648/2012 du Parlement européen (le « règlement SFTR »).

Une Opération de financement sur titres (« OFT ») est définie dans l'article 3(11) du règlement SFTR comme :

- ▶ une opération de mise ou prise en pension ;
- ▶ une opération de prêt ou d'emprunt de titres ou de matières premières ;
- ▶ une opération d'achat avec revente ou de vente avec rachat ;
- ▶ une opération de prêt sur marge.

Au 30 juin 2020, la Société exécutait des opérations de Prêt de Titres (voir Note 8 et Note 9.2).

Le règlement SFTR concerne également les opérations qui sont communément désignées sous le nom de Swap de Rendement Total (« Total Return Swap ou TRS ») (voir Note 4). La Société détenait de Swap de Rendement Total au 30 juin 2020.

Au 30 juin 2020, aucun réinvestissement de garanties en numéraire n'avait été réalisé pour les différents Compartiments.

6. Contrats à terme ferme (« futures »)

Au 30 juin 2020, les Compartiments à Réplication directe suivants présentaient des contrats à terme ferme (« futures ») en circulation :

Description	Nombre de contrats	Devise	Engagement	Date d'échéance	Plus-value / (moins-value) latente (dans la Devise du Compartiment)
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF					
EURO BUND	(8 300 000)	EUR	14 651 160	08/09/2020	(108 450)
Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF					
EURO BOBL	(4 000 000)	EUR	5 399 200	08/09/2020	(13 670)
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF					
EURO BOBL	(1 800 000)	EUR	2 429 640	08/09/2020	(6 350)

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

7. Contrats de change à terme

Au 30 juin 2020, le Compartiment Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF avait conclu les contrats de change à terme suivants :

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente EUR
USD	3 114 769	EUR	2 815 161	02/07/2020	(41 917)
USD	3 114 769	EUR	2 767 667	04/08/2020	3 591
Moins-value nette latente					(38 326)

State Street Bank London est la contrepartie à ces opérations sur contrats de change à terme ouverts.

Au 30 juin 2020, le Compartiment Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF avait conclu les contrats de change à terme suivants :

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en EUR
AUD	2 432 000	CHF	1 585 127	02/07/2020	695
AUD	15 198 700	EUR	9 263 886	02/07/2020	53 037
AUD	7 017 600	GBP	3 913 590	02/07/2020	(1 788)
AUD	1 444 800	USD	990 201	02/07/2020	2 023
CAD	4 534 000	CHF	3 151 994	02/07/2020	1 096
CAD	27 931 200	EUR	18 140 897	02/07/2020	118 007
CAD	12 807 600	GBP	7 610 140	02/07/2020	192
CAD	2 671 800	USD	1 949 887	02/07/2020	5 247
CHF	1 565 167	AUD	2 432 000	02/07/2020	(10 075)
CHF	3 180 033	CAD	4 534 000	02/07/2020	12 077
CHF	358 991	DKK	2 506 400	02/07/2020	518
CHF	14 543 663	EUR	13 622 000	02/07/2020	43 763
CHF	48 944 486	GBP	41 153 140	02/07/2020	358 313
CHF	5 016 764	JPY	559 814 800	02/07/2020	46 950
CHF	809 022	NZD	1 346 000	02/07/2020	(5 645)
CHF	989 014	SEK	9 756 800	02/07/2020	(1 552)
CHF	75 352 957	USD	78 158 600	02/07/2020	607 840
DKK	2 506 400	CHF	359 474	02/07/2020	(745)
DKK	15 647 500	EUR	2 099 443	02/07/2020	0
DKK	7 262 400	GBP	890 375	02/07/2020	(2 559)
DKK	1 502 400	USD	226 702	02/07/2020	(133)
EUR	9 158 770	AUD	15 198 700	02/07/2020	(158 155)
EUR	18 343 123	CAD	27 931 200	02/07/2020	84 219
EUR	13 622 000	CHF	14 557 973	02/07/2020	(57 209)
EUR	2 099 122	DKK	15 647 500	02/07/2020	(322)
EUR	323 953 019	GBP	291 474 478	02/07/2020	3 295 907
EUR	29 535 063	JPY	3 519 086 700	02/07/2020	492 757
EUR	4 758 810	NZD	8 452 400	02/07/2020	(85 807)
EUR	5 714 335	SEK	60 192 400	02/07/2020	(37 999)
EUR	448 908 790	USD	497 366 027	02/07/2020	6 077 454
GBP	3 803 884	AUD	7 017 600	02/07/2020	(58 556)
GBP	7 551 757	CAD	12 807 600	02/07/2020	(32 307)
GBP	41 153 140	CHF	48 131 603	02/07/2020	23 595
GBP	874 232	DKK	7 262 400	02/07/2020	(6 322)

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en EUR
GBP	290 826 452	EUR	318 360 840	02/07/2020	1 583 366
GBP	12 145 744	JPY	1 615 772 400	02/07/2020	13 571
GBP	1 964 885	NZD	3 884 000	02/07/2020	(32 281)
GBP	2 415 780	SEK	28 335 200	02/07/2020	(25 113)
GBP	207 351 680	USD	256 001 612	02/07/2020	90 037
JPY	559 814 800	CHF	4 938 368	02/07/2020	(10 118)
JPY	3 519 086 700	EUR	29 043 897	02/07/2020	(1 588)
JPY	1 615 772 400	GBP	12 184 034	02/07/2020	(34 634)
JPY	337 926 400	USD	3 137 259	02/07/2020	(2 215)
NZD	1 346 000	CHF	820 265	02/07/2020	364
NZD	8 452 400	EUR	4 819 815	02/07/2020	24 803
NZD	3 884 000	GBP	2 024 018	02/07/2020	(248)
NZD	818 600	USD	524 618	02/07/2020	1 049
SEK	9 756 800	CHF	995 729	02/07/2020	(1 602)
SEK	60 192 400	EUR	5 746 963	02/07/2020	5 371
SEK	28 335 200	GBP	2 473 061	02/07/2020	(6 394)
SEK	5 791 200	USD	621 768	02/07/2020	(76)
USD	962 148	AUD	1 444 800	02/07/2020	(14 511)
USD	1 941 557	CAD	2 671 800	02/07/2020	(8 956)
USD	78 158 600	CHF	74 304 087	02/07/2020	(115 061)
USD	222 972	DKK	1 502 400	02/07/2020	(1 528)
USD	497 218 376	EUR	442 194 699	02/07/2020	505 175
USD	256 131 480	GBP	208 156 877	02/07/2020	(475 130)
USD	3 141 229	JPY	337 926 400	02/07/2020	3 982
USD	509 506	NZD	818 600	02/07/2020	(7 776)
USD	607 903	SEK	5 791 200	02/07/2020	(6 096)
CHF	1 447 342	AUD	2 225 000	04/08/2020	(1 457)
CHF	2 756 724	CAD	3 978 800	04/08/2020	(4 216)
CHF	321 382	DKK	2 242 800	04/08/2020	578
CHF	13 296 918	EUR	12 449 800	04/08/2020	47 630
CHF	42 928 425	GBP	36 864 540	04/08/2020	(93 908)
CHF	4 497 441	JPY	510 245 000	04/08/2020	8 695
CHF	729 653	NZD	1 199 400	04/08/2020	(611)
CHF	904 619	SEK	8 874 800	04/08/2020	1 183
CHF	67 359 242	USD	70 976 600	04/08/2020	80 113
EUR	9 101 945	AUD	14 944 500	04/08/2020	(54 391)
EUR	17 213 912	CAD	26 536 000	04/08/2020	(122 424)
EUR	2 021 757	DKK	15 069 100	04/08/2020	26
EUR	268 161 213	GBP	245 952 700	04/08/2020	(2 280 944)
EUR	28 532 553	JPY	3 457 416 300	04/08/2020	8 069
EUR	4 624 492	NZD	8 119 100	04/08/2020	(26 038)
EUR	5 614 876	SEK	58 833 300	04/08/2020	(5 817)
EUR	423 551 733	USD	476 671 600	04/08/2020	(550 414)
GBP	3 516 075	AUD	6 294 600	04/08/2020	4 768
GBP	6 697 076	CAD	11 256 600	04/08/2020	4 905
GBP	780 791	DKK	6 345 400	04/08/2020	3 605

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en EUR
GBP	32 305 119	EUR	35 222 300	04/08/2020	299 432
GBP	10 926 325	JPY	1 443 556 600	04/08/2020	52 291
GBP	1 772 618	NZD	3 393 200	04/08/2020	2 765
GBP	2 197 733	SEK	25 107 800	04/08/2020	8 932
GBP	163 646 809	USD	200 802 800	04/08/2020	641 853
USD	990 303	AUD	1 444 800	04/08/2020	(2 063)
USD	1 892 600	CAD	2 592 400	04/08/2020	(4 888)
USD	226 849	DKK	1 502 400	04/08/2020	132
USD	9 073 305	EUR	8 062 200	04/08/2020	10 461
USD	29 627 995	GBP	24 145 800	04/08/2020	(94 752)
USD	3 138 511	JPY	337 926 400	04/08/2020	2 206
USD	521 527	NZD	813 600	04/08/2020	(1 005)
USD	622 009	SEK	5 791 200	04/08/2020	72
Plus-value nette latente					10 183 695

Barclays Bank Ireland PLC, BofA Securities Europe SA, Citigroup Global Markets Europe AG, J.P.Morgan AG, Royal Bank of Canada (UK) et State Street Bank London sont les contreparties à ces opérations sur contrats de change à terme ouverts.

Au 30 juin 2020, le Compartiment Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF avait conclu les contrats de change à terme suivants :

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en USD
EUR	531 598 678	USD	593 501 157	02/07/2020	3 563 914
USD	597 800 108	EUR	531 598 678	02/07/2020	735 037
EUR	510 255 864	USD	574 250 266	04/08/2020	(745 799)
Plus-value nette latente					3 553 152

Barclays Bank Ireland PLC, BofA Securities Europe SA, Citigroup Global Markets Europe AG, J.P.Morgan AG, Royal Bank of Canada (UK) et State Street Bank London sont les contreparties à ces opérations sur contrats de change à terme ouverts.

Au 30 juin 2020, le Compartiment Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF avait conclu les contrats de change à terme suivants :

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en EUR
AUD	6 319 400	CHF	4 118 952	02/07/2020	1 762
AUD	46 138 400	EUR	28 086 506	02/07/2020	196 700
AUD	9 805 200	GBP	5 458 029	02/07/2020	3 087
AUD	1 783 000	USD	1 221 988	02/07/2020	2 496
CAD	5 357 400	CHF	3 719 807	02/07/2020	3 459
CAD	38 898 900	EUR	25 254 297	02/07/2020	174 302
CAD	8 436 200	GBP	5 006 544	02/07/2020	3 513
CAD	1 521 000	USD	1 110 208	02/07/2020	2 908
CHF	4 069 136	AUD	6 319 400	02/07/2020	(25 166)
CHF	3 758 553	CAD	5 357 400	02/07/2020	14 745
CHF	998 831	DKK	6 972 000	02/07/2020	1 548
CHF	38 116 994	EUR	35 694 300	02/07/2020	121 836
CHF	12 768 966	GBP	10 735 200	02/07/2020	94 088

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en EUR
CHF	719 359	ILS	2 620 000	02/07/2020	962
CHF	43 889 420	JPY	4 899 280 600	02/07/2020	403 677
CHF	480 395	NOK	4 869 400	02/07/2020	992
CHF	557 706	SEK	5 500 000	02/07/2020	(785)
CHF	882 076	SGD	1 294 400	02/07/2020	1 358
CHF	88 641 819	USD	91 955 000	02/07/2020	709 360
DKK	6 972 000	CHF	1 000 031	02/07/2020	(2 113)
DKK	50 904 100	EUR	6 829 891	02/07/2020	(30)
DKK	10 818 400	GBP	1 325 664	02/07/2020	(3 438)
DKK	1 967 000	USD	296 806	02/07/2020	(174)
EUR	27 779 925	AUD	46 138 400	02/07/2020	(503 284)
EUR	25 547 057	CAD	38 898 900	02/07/2020	118 458
EUR	35 694 300	CHF	38 158 895	02/07/2020	(161 208)
EUR	6 828 812	DKK	50 904 100	02/07/2020	(1 047)
EUR	142 838 771	GBP	129 107 064	02/07/2020	805 414
EUR	4 915 516	ILS	19 128 700	02/07/2020	(5 474)
EUR	300 363 042	JPY	35 770 684 600	02/07/2020	5 154 845
EUR	3 280 685	NOK	35 522 500	02/07/2020	2 198
EUR	3 811 475	SEK	40 155 300	02/07/2020	(26 000)
EUR	6 030 435	SGD	9 451 200	02/07/2020	(1 538)
EUR	610 949 081	USD	676 424 206	02/07/2020	8 692 762
GBP	5 310 053	AUD	9 805 200	02/07/2020	(84 483)
GBP	4 971 512	CAD	8 436 200	02/07/2020	(22 781)
GBP	10 735 200	CHF	12 533 857	02/07/2020	16 371
GBP	1 302 250	DKK	10 818 400	02/07/2020	(9 443)
GBP	128 217 539	EUR	141 158 783	02/07/2020	(104 012)
GBP	937 544	ILS	4 065 000	02/07/2020	(7 169)
GBP	57 712 766	JPY	7 685 228 800	02/07/2020	33 188
GBP	632 275	NOK	7 610 400	02/07/2020	(3 404)
GBP	730 096	SEK	8 561 200	02/07/2020	(7 482)
GBP	1 157 473	SGD	2 023 200	02/07/2020	(8 946)
GBP	120 117 785	USD	148 500 750	02/07/2020	(37 012)
ILS	2 620 000	CHF	722 529	02/07/2020	(2 451)
ILS	19 128 700	EUR	4 934 470	02/07/2020	(13 482)
ILS	4 065 000	GBP	957 022	02/07/2020	(3 544)
ILS	739 000	USD	214 480	02/07/2020	(425)
JPY	4 899 280 600	CHF	43 197 785	02/07/2020	(78 734)
JPY	35 770 684 600	EUR	295 435 071	02/07/2020	(226 873)
JPY	7 685 228 800	GBP	57 905 204	02/07/2020	(139 040)
JPY	1 385 698 800	USD	12 864 634	02/07/2020	(9 087)
NOK	4 869 400	CHF	478 566	02/07/2020	(134)
NOK	35 522 500	EUR	3 264 592	02/07/2020	13 894
NOK	7 610 400	GBP	638 819	02/07/2020	(195)
NOK	1 368 400	USD	141 069	02/07/2020	346
SEK	5 500 000	CHF	561 514	02/07/2020	(1 004)
SEK	40 155 300	EUR	3 833 620	02/07/2020	3 852

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en EUR
SEK	8 561 200	GBP	746 843	02/07/2020	(1 730)
SEK	1 551 800	USD	166 608	02/07/2020	(20)
SGD	1 294 400	CHF	882 388	02/07/2020	(1 505)
SGD	9 451 200	EUR	6 026 441	02/07/2020	5 534
SGD	2 023 200	GBP	1 177 623	02/07/2020	(2 136)
SGD	365 200	USD	261 943	02/07/2020	(72)
USD	1 193 115	AUD	1 783 000	02/07/2020	(15 349)
USD	1 107 402	CAD	1 521 000	02/07/2020	(4 157)
USD	91 955 000	CHF	87 399 706	02/07/2020	(125 793)
USD	292 715	DKK	1 967 000	02/07/2020	(1 648)
USD	676 268 927	EUR	601 749 220	02/07/2020	368 848
USD	148 522 224	GBP	120 542 332	02/07/2020	(186 954)
USD	211 270	ILS	739 000	02/07/2020	(1 004)
USD	12 892 118	JPY	1 385 698 800	02/07/2020	21 323
USD	140 086	NOK	1 368 400	02/07/2020	(784)
USD	163 410	SEK	1 551 800	02/07/2020	(1 403)
USD	258 486	SGD	365 200	02/07/2020	(1 468)
CHF	3 958 622	AUD	6 085 600	04/08/2020	(3 988)
CHF	3 554 752	CAD	5 130 600	04/08/2020	(5 436)
CHF	962 111	DKK	6 714 200	04/08/2020	1 729
CHF	36 712 855	EUR	34 374 000	04/08/2020	131 464
CHF	12 038 741	GBP	10 338 200	04/08/2020	(26 335)
CHF	695 485	ILS	2 523 000	04/08/2020	2 277
CHF	41 586 309	JPY	4 718 062 400	04/08/2020	80 396
CHF	377 440	NOK	3 856 000	04/08/2020	(463)
CHF	539 889	SEK	5 296 600	04/08/2020	706
CHF	848 627	SGD	1 246 600	04/08/2020	1 255
CHF	83 185 531	USD	87 652 800	04/08/2020	98 935
EUR	26 195 463	AUD	43 010 400	04/08/2020	(156 550)
EUR	23 529 970	CAD	36 272 500	04/08/2020	(167 357)
EUR	6 368 942	DKK	47 470 700	04/08/2020	79
EUR	79 678 724	GBP	73 079 900	04/08/2020	(677 725)
EUR	4 601 356	ILS	17 829 100	04/08/2020	14 304
EUR	275 239 907	JPY	33 352 114 500	04/08/2020	77 250
EUR	2 493 604	NOK	27 208 500	04/08/2020	(16 073)
EUR	3 574 518	SEK	37 454 200	04/08/2020	(3 703)
EUR	5 613 428	SGD	8 807 200	04/08/2020	(3 883)
EUR	550 573 997	USD	619 624 400	04/08/2020	(715 482)
GBP	4 648 775	AUD	8 322 400	04/08/2020	6 304
GBP	4 175 336	CAD	7 018 000	04/08/2020	3 058
GBP	1 130 347	DKK	9 186 200	04/08/2020	5 219
GBP	43 125 251	EUR	47 019 500	04/08/2020	399 723
GBP	816 586	ILS	3 449 800	04/08/2020	5 166
GBP	48 855 648	JPY	6 454 683 600	04/08/2020	233 781
GBP	442 495	NOK	5 264 200	04/08/2020	495
GBP	634 326	SEK	7 246 800	04/08/2020	2 578

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en EUR
GBP	996 421	SGD	1 704 600	04/08/2020	4 213
GBP	97 722 331	USD	119 910 000	04/08/2020	383 364
USD	1 222 114	AUD	1 783 000	04/08/2020	(2 546)
USD	1 097 422	CAD	1 503 200	04/08/2020	(2 834)
USD	297 000	DKK	1 967 000	04/08/2020	172
USD	11 333 473	EUR	10 070 500	04/08/2020	13 067
USD	3 716 475	GBP	3 028 800	04/08/2020	(11 885)
USD	214 641	ILS	739 000	04/08/2020	420
USD	12 837 758	JPY	1 382 253 200	04/08/2020	9 022
USD	116 508	NOK	1 129 600	04/08/2020	(267)
USD	166 672	SEK	1 551 800	04/08/2020	19
USD	261 958	SGD	365 200	04/08/2020	70
Plus-value nette latente					14 820 384

Barclays Bank Ireland PLC, BofA Securities Europe SA, Citigroup Global Markets Europe AG, HSBC France, J.P.Morgan AG, Royal Bank of Canada (UK) et State Street Bank London sont les contreparties à ces opérations sur contrats de change à terme ouverts.

Au 30 juin 2020, le Compartiment Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF avait conclu les contrats de change à terme suivants :

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value / (moins-value) latente en USD
EUR	707 601 936	USD	783 563 073	02/07/2020	11 180 066
USD	795 915 903	EUR	707 601 936	02/07/2020	1 172 765
EUR	651 287 285	USD	732 963 513	04/08/2020	(946 120)
Plus-value nette latente					11 406 711

Barclays Bank Ireland PLC, BofA Securities Europe SA, Citigroup Global Markets Europe AG, J.P.Morgan AG, Royal Bank of Canada (UK) et State Street Bank London sont les contreparties à ces opérations sur contrats de change à terme ouverts.

8. Prêt de Titres

Les Compartiments à Politique d'Investissement Direct peuvent souscrire des opérations de prêt de titres (les « Opérations de Prêt de Titres ») pouvant représenter jusqu'à 50 % (ou, au plus, 30 % pour les Compartiments autorisés à une Politique d'Investissement Direct) de leurs actifs, pour générer des revenus supplémentaires et donc compenser tout ou partie de leurs coûts. Ces opérations sont strictement réglementées et doivent, entre autres, pouvoir être résiliées à tout moment à l'initiative de la Société. Les Opérations de Prêt de Titres génèrent cependant certains risques, notamment des risques opérationnels et liés à la valorisation, au marché et aux contreparties.

En fonction de la valeur des Opérations de Prêt de Titres et de la politique sélectionnée, un Compartiment peut à tout moment être exposé, partiellement ou totalement, au risque d'une ou de plusieurs contreparties, auquel cas une garantie adaptée ou tout autre contrat d'atténuation du risque de contrepartie conforme à (i) la Partie I de la loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010, telle que modifiée, (ii) toute modification ou loi de remplacement de la loi précitée, en vigueur le cas échéant, (iii) toute réglementation, de tout type que ce soit prise en égard à la loi mentionnée aux points (i) et (ii), (iv) la Directive 2014/91/UE du Parlement européen et du Conseil du 23 juillet 2014 relative aux fonctions de dépositaire, politiques de rémunération et sanctions, y compris les législations d'application obligatoires au niveau des États membres ou de l'UE, (v) toute convention de sous-dépositaire conclue entre l'Agent de Prêt de Titres (défini ci-dessous), la Société, la Société de gestion et State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg (« SSBL »), ainsi que (vi) tout règlement, toute ligne directrice et position générale ou spécifique adopté(e) de temps à autre par la CSSF à cet égard (la « Réglementation ») doit être pris/mis en œuvre et/ou un paiement doit être versé par les contreparties des Opérations de Prêt de Titres de sorte que le pourcentage d'exposition au risque de contrepartie demeure dans les limites fixées par la Réglementation.

Pour les Compartiments dotés d'une Politique d'Investissement Direct, la Société a désigné Deutsche Bank AG, agissant par l'intermédiaire de son siège de Francfort et de ses succursales de Londres et de New York, en qualité d'Agent de Prêt de Titres (l'« Agent de Prêt de Titres »). L'Agent de Prêt de Titres est autorisé à (i) conclure des Opérations de Prêt de Titres pour le compte de la Société et (ii) investir toute somme reçue/détenue au nom de la Société en tant que garanties en vertu de ces Opérations de Prêt de Titres, conformément et dans les limites prévues au Contrat d'agent de rachat et prêt de titres, des règles figurant dans le Prospectus et de la Réglementation en vigueur.

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

8. Prêt de Titres (suite)

Le Dépositaire (State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg) a délégué à Deutsche Bank AG la fonction de garde de certaines garanties non-numéraires reçues par les Compartiments.

Tout revenu généré par des Opérations de Prêt de Titres (minoré de tous frais et commissions opérationnels directs ou indirects applicables encourus et versés à l'Agent de Prêt de Titres et, le cas échéant, à la Société de Gestion, au Gestionnaire d'Investissement et/ou au Gestionnaire de Portefeuille Délégué concerné(s)) sera reversé au Compartiment correspondant. Sauf mention contraire dans l'Annexe Produit correspondante et dans la mesure où un Agent de Prêt de Titres entend des Opérations de Prêt de Titres pour un Compartiment, l'Agent de Prêt de Titres, la Société de Gestion, le Gestionnaire d'Investissement et/ou le Gestionnaire de portefeuille délégué concerné(s), selon les cas, recevra(ont) une commission pour les services fournis en la matière.

Sur la période close le 30 juin 2020, les Compartiments ont rapporté des revenus nets intégrés à l'État des opérations et variations de l'Actif net et au poste « Revenus issus du Prêt de Titres, nets ».

Au cours de la période financière close le 30 juin 2020, l'Agent de Prêt de Titres et DWS Investments UK Limited (« DWS UK ») ont reçu les parts suivantes des revenus bruts générés sur les opérations de prêt, afin de couvrir l'estimation de leurs coûts et frais opérationnels, indirects ou directs sur les services proposés à cet effet et la supervision des Opérations de Prêt de Titres.

Toutes les opérations de Prêt de Titres sont réglées de manière bilatérale.

Compartiment	Agent de Prêt de Titres	DWS UK	Compartiment
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND 1-10 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND 0-3 UCITS ETF	15 %	15 %	70 %

La valeur des titres prêtés et la valeur de marché de la garantie en numéraire et de la garantie non-numéraire reçues par chaque Compartiment au 30 juin 2020 sont détaillées dans le tableau suivant :

Compartiment	Devise du Compartiment	Valeur de marché des titres prêtés au 30 juin 2020 (en EUR)	Valeur de marché de la garantie reçue au 30 juin 2020 (en EUR)	Garanties en pourcentage de la valeur de marché des titres prêtés au 30 juin 2020
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	127 497 807	141 747 770	111,18 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	62 713 927	67 137 684	107,05 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	32 734 540	34 494 269	105,38 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	20 678 294	21 764 839	105,25 %

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

8. Prêt de Titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Valeur de marché des titres prêtés au 30 juin 2020 (en EUR)	Valeur de marché de la garantie reçue au 30 juin 2020 (en EUR)	Garanties en pourcentage de la valeur de marché des titres prêtés au 30 juin 2020
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	0	1 730 985	0,00 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	0	553 909	0,00 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	74 230 975	79 332 809	106,87 %
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	4 651 782	4 918 845	105,74 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	USD	0	164 855	0,00 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	47 070 306	54 701 567	116,21 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	22 377 550	24 562 943	109,77 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	4 285 730	7 323 046	170,87 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	0	1 025	0,00 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	16 906 529	17 796 427	105,26 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	1 981 901	2 175 413	109,76 %

Les développements suivants résument la valeur des titres non séparés par devise et des garanties connexes reçues, analysée pour chaque contrepartie à l'opération d'emprunt, au 30 juin 2020 :

Compartiment	Devise du Compartiment	Contrepartie	Pays de constitution de la Contrepartie	Titres prêtés en EUR	Garantie non-numéraire reçue en EUR	% de l'Actif net
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	12 751 597	13 629 861	0,35 %
		BNP Paribas Paris	France	1 785 721	9 342 818	0,05 %
		Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	112 960 489	118 756 192	3,13 %
		JP Morgan Securities Plc	États-Unis	0	18 899	0,00 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	BNP Paribas Paris	France	0	1 134 833	0,00 %
		Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	62 713 927	66 002 851	13,98 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	32 734 540	34 493 756	12,67 %
		JP Morgan Securities Plc	États-Unis	0	513	0,00 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	20 678 294	21 755 097	6,06 %
		JP Morgan Securities Plc	États-Unis	0	9 742	0,00 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	BNP Paribas Paris	France	0	1 642 237	0,00 %
		Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	0	13 752	0,00 %
		JP Morgan Securities Plc	États-Unis	0	9 229	0,00 %
		Merrill Lynch International	États-Unis	0	65 767	0,00 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	BNP Paribas Paris	France	0	553 909	0,00 %

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

8. Prêt de Titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Contrepartie	Pays de constitution de la Contrepartie	Titres prêtés en EUR	Garantie non-numéraire reçue en EUR	% de l'Actif net
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	BNP Paribas Paris	France	70 742 139	75 619 326	4,97 %
		Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	3 488 836	3 713 483	0,24 %
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	4 651 782	4 918 845	1,16 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	USD	Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	0	64 715	0,00 %
		BNP Paribas Paris	France	0	100 140	0,00 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	2 550 319	2 795 291	0,10 %
		BNP Paribas Paris	France	27 978 587	34 225 313	1,09 %
		Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	16 541 400	17 608 230	0,65 %
		JP Morgan Securities Plc	États-Unis	0	6 966	0,00 %
		Merrill Lynch International	États-Unis	0	65 767	0,00 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	BNP Paribas Paris	France	22 377 550	24 562 943	1,99 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	BNP Paribas Paris	France	4 285 730	7 323 046	1,58 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	JP Morgan Securities Plc	États-Unis	0	1 025	0,00 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	16 906 529	17 777 968	3,32 %
		JP Morgan Securities Plc	États-Unis	0	18 459	0,00 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	1 353 341	1 478 979	0,34 %
		BNP Paribas Paris	France	628 560	696 434	0,16 %

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

8. Prêt de Titres (suite)

Veillez voir la Note 9.2 pour consulter la valeur de marché des titres en Prêt selon la Durée d'échéance.

Le tableau qui suit récapitule la valeur des garanties reçues (analysées par devise), au 30 juin 2020 :

Compartiment	Devise du Compartiment	Devise du titre	Garantie non-numéraire reçue en EUR
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	EUR	141 431 916
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CAD	315 854
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	EUR	67 032 399
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	CAD	105 285
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	EUR	34 494 269
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	EUR	21 764 839
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	EUR	1 730 985
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	EUR	553 909
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	EUR	31 210 518
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	CAD	48 122 291
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	EUR	4 918 845
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	USD	EUR	164 855
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	EUR	38 476 465
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CAD	16 225 102
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	EUR	5 297 199
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	CAD	19 265 744
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	EUR	6 799 185
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CAD	523 861
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	EUR	1 025
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	EUR	17 796 427
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	EUR	2 175 413

9. Garantie

9.1 Garanties reçues au regard des conventions de Swap

La Société peut être contrainte de fournir une marge de variation pour un Compartiment (à savoir les garanties remises par une contrepartie pour tenir compte des résultats de la valorisation journalière au marché ou la modélisation au marché des contrats dérivés de gré à gré non compensés) à sa contrepartie d'une Transaction sur des instruments dérivés négociés de gré à gré. Concernant les Transactions sur des instruments dérivés négociées de gré à gré réalisées entre la Société et des contreparties (dont les Contreparties de Swap), la Société peut livrer ou recevoir les garanties demandées par transfert de propriété ou par nantissement, selon les clauses du contrat conclu entre le Compartiment concerné et la contrepartie.

La valeur des garanties non-numéraires mises en nantissement et des garanties en numéraire reçues via une contrepartie est détaillée pour chaque Compartiment dans le tableau suivant, au 30 juin 2020 :

Compartiments	Devise des Compartiments	Contrepartie	Pays de la contrepartie	Garantie non-numéraire mise en nantissement (dans la Devise du Compartiment)	Garantie en numéraire reçue (dans la Devise du Compartiment)	% de l'Actif net
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	38 666 688	7,05 %

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

9. Garantie (suite)

9.1 Garantie reçue au regard de conventions de Swap (suite)

Compartiments	Devise des Compartiments	Contrepartie	Pays de la contrepartie	Garantie non-numéraire mise en nantissement (dans la Devise du Compartiment)	Garantie en numéraire reçue (dans la Devise du Compartiment)	% de l'Actif net
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	1 966 570	1,73 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	657 000	1,45 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	535 000	1,25 %
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	1 312 777	1,61 %
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	USD	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	2 236 143	0,98 %
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	GBP	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	38 550	0,04 %
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	376 000	0,41 %
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	1 431 571	1,23 %
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	311 094	3,49 %
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	USD	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	19 854 591	2,25 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG - succursale de Londres	Royaume-Uni	0	7 065 680	3,50 %

Le tableau suivant présente une analyse par devise de la garantie non-numéraire sous-jacente mise en nantissement et de la garantie en numéraire reçue, au 30 juin 2020 :

Compartiments	Devise des Actif sous-jacent	Garantie non-numéraire mise en nantissement (dans la Devise du Compartiment)	Garantie en numéraire reçue (dans la Devise du Compartiment)
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	EUR	0	38 666 688

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

9. Garantie (suite)

9.1 Garantie reçue au regard de conventions de Swap (suite)

Compartiments	Devise des Actif sous-jacent	Garantie non-numéraire mise en nantissement (dans la Devise du Compartiment)	Garantie en numéraire reçue (dans la Devise du Compartiment)
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	EUR	0	1 966 570
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	EUR	0	657 000
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	EUR	0	535 000
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	EUR	0	1 312 777
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	USD	0	2 236 143
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	GBP	0	38 550
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	EUR	0	376 000
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	EUR	0	1 431 571
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	EUR	0	311 094
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	USD	0	19 854 591
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	EUR	0	7 065 680

Au 30 juin 2020, aucune des garanties en numéraire reçues au titre des conventions de Swap n'est réutilisée.

Le Dépositaire (State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg) a délégué à State Street Bank and Trust Company la fonction de garde de certaines garanties non-numéraires reçues par les Compartiments. En tant que sous-dépositaire mondial, State Street Bank and Trust Company a désigné des sous-dépositaires locaux au sein du réseau State Street Global Custody Network.

Le tableau suivant présente une analyse de la durée d'échéance des garanties non-numéraires mises en nantissement et des garanties en numéraire reçues au regard des conventions de Swap, au 30 juin 2020 :

Compartiments	Devise des Compartiments	Durée d'échéance	Non-numéraire non-numéraire mise en nantissement (dans la Devise du Compartiment)	Garantie en numéraire reçue (dans la Devise du Compartiment)
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	38 666 688
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	1 966 570
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	657 000

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

9. Garantie (suite)

9.1 Garanties reçues au regard des conventions de Swap (suite)

Compartiments	Devise des Compartiments	Durée d'échéance	Garantie non-numéraire mise en nantissement (dans la Devise du Compartiment)	Garantie en numéraire reçue (dans la Devise du Compartiment)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	535 000
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	1 312 777
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	USD	Opérations ouvertes	0	2 236 143
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	GBP	Opérations ouvertes	0	38 550
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	376 000
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	1 431 571
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	311 094
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	USD	Opérations ouvertes	0	19 854 591
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	7 065 680

9.2 Garantie reçue au regard d'opérations de Prêt de Titres

Le tableau suivant présente une analyse de la durée d'échéance des garanties en numéraire et non-numéraires associées reçues au 30 juin 2020 :

Compartiment	Durée d'échéance	Valeur de marché du prêt (en EUR)	Garantie reçue (en EUR)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	8 à 30 jours	0	4 626 655
	91 à 365 jours	0	16 633 882
	Plus de 365 jours	127 497 807	120 487 233
	Total	127 497 807	141 747 770
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	91 à 365 jours	10 066 100	100 140
	Plus de 365 jours	52 647 827	67 037 544
	Total	62 713 927	67 137 684
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	Plus de 365 jours	32 734 540	34 494 269
	Total	32 734 540	34 494 269
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	Plus de 365 jours	20 678 294	21 764 839
	Total	20 678 294	21 764 839
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	8 à 30 jours	0	197 302
	Plus de 365 jours	0	1 533 683
	Total	0	1 730 985
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	Plus de 365 jours	0	553 909
	Total	0	553 909

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

9. Garantie (suite)

9.2 Garantie reçue au regard d'opérations de Prêt de Titres (suite)

Compartiment	Durée d'échéance	Valeur de marché du prêt (en EUR)	Garantie reçue (en EUR)
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	8 à 30 jours	0	1 631 031
	91 à 365 jours	0	4 674 864
	Plus de 365 jours	74 230 975	73 026 914
	Total	74 230 975	79 332 809
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Plus de 365 jours	4 651 782	4 918 845
	Total	4 651 782	4 918 845
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	91 à 365 jours	0	100 140
	Plus de 365 jours	0	64 715
	Total	0	164 855
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	8 à 30 jours	0	2 926 825
	91 à 365 jours	0	290 671
	Plus de 365 jours	47 070 306	51 484 071
	Total	47 070 306	54 701 567
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	8 à 30 jours	0	670 827
	91 à 365 jours	0	210 825
	Plus de 365 jours	22 377 550	23 681 291
	Total	22 377 550	24 562 943
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	91 à 365 jours	0	240 335
	Plus de 365 jours	4 285 730	7 082 711
	Total	4 285 730	7 323 046
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Plus de 365 jours	0	1 025
	Total	0	1 025
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	91 à 365 jours	0	17 585 889
	Plus de 365 jours	16 906 529	210 538
	Total	16 906 529	17 796 427
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	8 à 30 jours	0	65 767
	Plus de 365 jours	1 981 901	2 109 646
	Total	1 981 901	2 175 413

Le tableau suivant répertorie les dix plus grands émetteurs par valeur de garantie non-numéraire reçue par les Compartiments par le biais d'un contrat de garantie par transfert de propriété pour toutes les opérations de Prêt de Titres au 30 juin 2020 :

Compartiment	Type de garantie	Émetteur de la garantie	Valeur de marché de la garantie (en EUR)	% de l'Actif net
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France	98 729 219	2,73 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	26 185 260	0,72 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Autriche	14 757 840	0,41 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	1 659 457	0,05 %
	Revenu fixe	Obligation d'État du Canada	315 854	0,01 %
	Revenu fixe	Land de Brême	100 140	0,00 %

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

9. Garantie (suite)

9.2 Garantie reçue au regard d'opérations de Prêt de Titres (suite)

Compartiment	Type de garantie	Émetteur de la garantie	Valeur de marché de la garantie (en EUR)	% de l'Actif net
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	32 656 599	7,28 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France	32 198 739	7,18 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Autriche	1 916 582	0,43 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	160 339	0,04 %
	Revenu fixe	Obligation d'État du Canada	105 285	0,02 %
	Revenu fixe	Land de Brême	100 140	0,02 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France	21 660 507	8,38 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	12 833 762	4,97 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France	21 764 839	6,38 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	1 242 785	1,34 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France	220 283	0,24 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	213 786	0,23 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Autriche	54 131	0,06 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	505 807	1,47 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	48 102	0,14 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État du Canada	48 122 291	3,38 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	17 743 416	1,25 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	4 671 204	0,33 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France	4 473 342	0,31 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Autriche	2 490 003	0,17 %
	Revenu fixe	Land de Brême	1 832 553	0,13 %
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	4 633 568	1,16 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France	285 277	0,07 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Land de Brême	100 140	0,01 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Autriche	52 790	0,00 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France	11 925	0,00 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	19 140 177	0,75 %
	Revenu fixe	Obligation d'État du Canada	16 225 102	0,63 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France	15 323 186	0,60 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Autriche	2 957 682	0,12 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	855 141	0,03 %
	Revenu fixe	Land de Brême	200 279	0,01 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État du Canada	19 265 744	1,71 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	2 571 561	0,23 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	1 352 191	0,12 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France	851 610	0,08 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Autriche	491 795	0,04 %
	Revenu fixe	Land de Brême	30 042	0,00 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	6 366 444	2,35 %
	Revenu fixe	Obligation d'État du Canada	523 861	0,19 %
	Revenu fixe	Land de Brême	240 335	0,09 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	192 406	0,07 %

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

9. Garantie (suite)

9.2 Garantie reçue au regard d'opérations de Prêt de Titres (suite)

Compartiment	Type de garantie	Émetteur de la garantie	Valeur de marché de la garantie (en EUR)	% de l'Actif net
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France	1 025	0,01 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France	17 774 993	3,49 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	21 434	0,00 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Allemagne	880 106	0,22 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France	744 134	0,19 %
	Revenu fixe	Obligation d'État des Pays-Bas	519 560	0,13 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Autriche	31 613	0,01 %

Les titres à revenu fixe sont ceux ayant obtenu une notation de crédit « investment grade » de la part d'au moins une agence de notation de crédit mondialement reconnue : Standard & Poor's, Moody's ou Fitch.

10. Commission de la Société de Gestion et Commissions Fixes

a) Commission de la Société de Gestion

Conformément aux dispositions du Contrat de Société de Gestion et sous réserve de ces dispositions, la Commission de la Société de Gestion annuelle s'accumule chaque jour calendaire et sera calculée chaque Jour d'évaluation sur la base d'un pourcentage (i) de la dernière Valeur Liquidative disponible de chaque Compartiment ou Catégorie d'Actions ou (ii) du Prix d'Émission initial multiplié par le nombre d'Actions en circulation de chaque Compartiment ou Catégorie d'Actions (tel que spécifié pour chaque Compartiment ou Catégorie d'Actions dans l'Annexe Produit correspondante).

La Société de Gestion a également droit au remboursement des dépenses qu'elle a raisonnablement engagées en sa capacité de Société de Gestion de la Société dans le cadre de l'exécution du Contrat de Société de Gestion et qui n'étaient pas raisonnablement prévisibles dans le cadre ordinaire de son activité.

Indépendamment de ce qui précède, la Société de Gestion et la Société peuvent convenir d'une grille de commission différente relativement à un Compartiment ou à une Catégorie d'Actions donné(e), tel qu'indiqué dans l'Annexe Produit correspondante.

La Société de Gestion peut payer une Commission de distribution au Distributeur sur la Commission de la Société de Gestion. Un Distributeur peut reverser une partie de la Commission de distribution à un distributeur délégué (si applicable). La Société de Gestion devra rémunérer le Gestionnaire d'Investissement et/ou le Gestionnaire de Portefeuille Délégué sur la Commission de la Société de Gestion comme convenu ponctuellement entre les deux parties.

b) Commissions Fixes

Aux termes d'un contrat conclu entre la Société et DWS Investments UK Limited⁽¹⁾ (l'« Agent de Commissions Fixes »), l'Agent de Commissions Fixes paiera, en échange du paiement de Commissions Fixes calculées sur la base de la moyenne de la Valeur Liquidative journalière par Compartiment ou par Catégorie, à un taux spécifié dans le tableau ci-dessous et dues périodiquement qui lui sont versées, certaines commissions et dépenses, sauf indication contraire dans l'Annexe Produit correspondante.

Les commissions et dépenses couvertes par l'accord comprennent la Commission d'Agent Administratif, la Commission du Dépositaire, la Commission de l'Agent de Registre, la Commission de l'Agent de Transfert et la Commission de l'Agent de Cotation, ainsi que la taxe annuelle au Luxembourg (le cas échéant) (la « Taxe d'Abonnement »), les frais d'établissement et certains Autres Frais Administratifs.

Les Commissions Fixes n'incluent pas les commissions, dépenses et coûts suivants :

- la Commission de Gestionnaire d'Investissement ;
- la Commission de la Société de Gestion ;

⁽¹⁾ Voir note 11. Parties liées.

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

10. Commission de la Société de Gestion et Commissions Fixes (suite)

b) Commissions Fixes (suite)

- les coûts de toute agence de marketing désignée par la Société ou la Société de Gestion afin de fournir certains services de marketing et de distribution à la Société ou à la Société de gestion ;
- tout(e) taxe ou impôt que la Société pourrait être dans l'obligation de payer, à l'exception de la Taxe d'Abonnement, le cas échéant, ou, en cas d'obligation de paiement, toute taxe sur la valeur ajoutée ou des taxes de vente ou service similaires payables par la Société (TVA) (tout(e)s ces taxes ou ces impôts), sauf mention contraire spécifiée dans l'Annexe Produit correspondante ;
- dépenses découlant d'une quelconque activité commerciale ou promotionnelle en lien avec la Société ; ou
- tout coût ou toute dépense supporté(e) en dehors du cours normal des activités de la Société, comme les dépenses extraordinaires (par exemple, les frais juridiques visant à engager des poursuites ou à se défendre dans le cadre d'une plainte ou d'une allégation, en faveur ou à l'encontre de la Société).

En particulier, l'Agent de Commissions Fixes paiera les factures des conseillers juridiques, des agents payeurs locaux et des traducteurs dans la mesure où ces factures cumulées ne dépassent pas un plafond global de dix millions d'euros (10 000 000 EUR) par exercice et la Société sera tenue de payer tout montant supérieur à ce plafond. La Société paiera ce montant au moyen des actifs du Compartiment concerné auquel les coûts correspondants sont imputables.

Compartiment	Commission de la Société de Gestion en % (par an)	Commissions Fixes en % (par an)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 1C	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 1D	jusqu'à 0,01 % par an	0,08 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 2C-USD Hedged	jusqu'à 0,10 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 1C-EUR Hedged, 1D-EUR Hedged, 2C-USD Hedged, 3D-GBP Hedged et 4D-CHF Hedged	jusqu'à 0,15 % par an	0,10 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 5C	jusqu'à 0,10 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,10 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,02 % par an	0,08 %
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,08 % par an	0,10 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,14 % par an	0,10 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,14 % par an	0,10 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 1C-EUR Hedged	jusqu'à 0,30 % par an	0,10 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 2C et 2D	jusqu'à 0,15 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 1C-EUR Hedged, 1D-EUR Hedged, 2D-GBP Hedged, 3C-USD Hedged et 4C-CHF Hedged	jusqu'à 0,15 % par an	0,10 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 5C	jusqu'à 0,10 % par an	0,10 %
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,10 % par an	0,10 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 1D	jusqu'à 0,01 % par an	0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 2D-EUR Hedged	jusqu'à 0,01 % par an	0,09 %
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	jusqu'à 0,01 % par an	0,06 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	jusqu'à 0,02 % par an	0,10 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

10. Commission de la Société de Gestion et Commissions Fixes (suite)

b) Commissions Fixes (suite)

Compartiment	Commission de la Société de Gestion en % (par an)	Commissions Fixes en % (par an)
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,06 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,15 % par an	0,10 %
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,10 % par an	0,10 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 1D	jusqu'à 0,05 % par an	0,10 %
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF Pour la Catégorie d'Actions 2C-USD Hedged, 3D-GBP Hedged, 4C-CHF Hedged and 5C-EUR Hedged	jusqu'à 0,10 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,10 % par an	0,10 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	jusqu'à 0,25 % par an	0,10 %
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,25 % par an	0,15 %
Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF	jusqu'à 0,20 % par an	0,10 %

⁽¹⁾ Du 1^{er} septembre 2019 jusqu'au 31 août 2020, la Commission de la Société de Gestion du présent compartiment a été réduite de 0,06 % à 0,02 %.

11. Parties liées

DWS Investment S.A. a été désignée Société de Gestion dans le cadre du Contrat de Société de Gestion et est chargée de fournir des services de gestion d'investissement, des services Administratif et des services de distribution et de marketing aux différents Compartiments, sauf indication contraire dans l'Annexe Produit correspondante. DWS Investment S.A. a le droit de percevoir des Commissions de la Société de Gestion, telles que détaillées à la Note 10, à titre de rémunération pour ses services à la Société.

L'Agent de Commissions Fixes est en droit de percevoir des Commissions Fixes, telles que précisées plus en détail à la Note 10.

DWS Investments UK Limited, DWS Investment GmbH et DWS Investments Hong Kong Limited agissent en qualité de Gestionnaire d'Investissement et/ou de Gestionnaire de Portefeuille Délégué pour certains Compartiments, tel que décrit plus en détail à la Note 12. La Société de Gestion devra rémunérer le Gestionnaire d'Investissement et/ou le Gestionnaire de Portefeuille Délégué sur la Commission de la Société de Gestion comme convenu ponctuellement entre les deux parties.

DWS Investments UK Limited a été désignée pour fournir certains services y compris, à titre non exhaustif, des conseils juridiques, réglementaires et fiscaux, la gestion des relations, la distribution et le marketing, l'assistance en matière de structuration et de restructuration et l'assistance relative aux enregistrements de la Société.

Durant la période close le 30 juin 2020, Deutsche Bank AG était la contrepartie à toutes les conventions de Swap conclues par la Société.

Deutsche Bank AG, agissant en qualité d'Agent de Prêt de Titres par l'intermédiaire de son siège de Francfort et de ses succursales de Londres et de New York, peut percevoir des commissions pour couvrir les coûts et frais d'exploitation directs ou indirects découlant des Opérations de Prêt de Titres, telles que décrites de façon plus détaillée à la Note 8.

Dans l'exercice normal de ses activités, chaque Compartiment peut effectuer des opérations sur titres ou d'autres Investissements avec Deutsche Bank AG ou d'autres sociétés affiliées de Deutsche Bank AG.

DWS Investments UK Limited est en droit de percevoir des commissions découlant des Opérations de Prêt de Titres, comme présenté plus en détail à la Note 8.

Deutsche Bank AG, agissant par l'intermédiaire de sa succursale de Londres, a été chargée des services de reporting de position.

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

12. Gestionnaires d'Investissement et Gestionnaires de Portefeuille Délégués désignés

Au 30 juin 2020, DWS Investment GmbH agit en qualité de Gestionnaire d'Investissement pour tous les Compartiments, sauf pour les Compartiments figurant ci-dessous.

Au 30 juin 2020, DWS Investments UK Limited agit en qualité de Gestionnaire d'Investissement pour les Compartiments suivants :

- Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF
- Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF

Au 30 juin 2020, Harvest Global Investments Limited agit comme Gestionnaire d'Investissement pour le Compartiment suivant :

- Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF

DWS Investments UK Limited a désigné DWS International GmbH pour fournir des services de meilleure exécution pour les Compartiments à Réplication indirecte.

Sauf mention contraire dans l'Annexe Produit concernée du Prospectus, DWS Investments UK Limited et DWS Investments Hong Kong Limited peuvent agir en tant que Gestionnaire de Portefeuille Délégué pour les Compartiments à Réplication directe pour lesquels DWS Investment GmbH agit en qualité de Gestionnaire d'Investissement.

13. Dividendes distribués

Au cours de la période close le 30 juin 2020, la Société a décidé de verser les dividendes aux Actionnaires des Actions de distribution des Compartiments mentionnés ci-dessous de la façon suivante :

Compartiment	Catégorie d'Actions	Date ex-dividende	Devise de la Catégorie d'Actions	Dividende par Action
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	17 juin 2020	EUR	0,6589
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	17 juin 2020	EUR	0,7696
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	17 juin 2020	EUR	3,3104
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	17 juin 2020	GBP	0,2864
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged	17 juin 2020	CHF	1,6914
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	17 juin 2020	USD	0,6579
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	17 juin 2020	GBP	1,0178
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	17 juin 2020	EUR	2,2827
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	17 juin 2020	GBP	0,2800
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	17 juin 2020	USD	2,5811
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged	17 juin 2020	EUR	2,3076
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	17 juin 2020	USD	4,2047
Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	17 juin 2020	EUR	0,6950
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	17 juin 2020	EUR	2,1012
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	1D	17 juin 2020	EUR	0,6478

Xtrackers II

Notes aux États Financiers (suite)

13. Dividendes distribués (suite)

Compartiment	Catégorie d'Actions	Date ex-dividende	Devise de la Catégorie d'Actions	Dividende par Action
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	1D	17 juin 2020	USD	0,6838
Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	3D - GBP Hedged	17 juin 2020	GBP	1,1025
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	17 juin 2020	EUR	0,3976
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	17 juin 2020	EUR	0,2885
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	17 juin 2020	USD	0,4521
Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	17 juin 2020	USD	3,4651

14. Commissions en nature

Aucun accord portant sur des commissions en nature n'a été conclu par la Société de Gestion ou le Gestionnaire d'Investissement et/ou le Gestionnaire de Portefeuille Délégué concerné(s) avec les courtiers au cours de la période close le 30 juin 2020.

1. Publication en ligne sur Internet des portefeuilles d'investissement, des garanties détenues et des expositions aux Swaps

Les Actionnaires peuvent consulter les expositions aux Swaps et les portefeuilles d'investissements ou garanties détenues pour chaque Compartiment sur www.etf.dws.com. Les informations se trouvent sous l'onglet « Données sur l'ETF » de chaque Compartiment.

2. Ajustements des Opérations de Swap négociées de gré à gré pour refléter les coûts de réplification de l'indice

En vertu du Prospectus, chaque Contrepartie de Swap peut effectuer des opérations de couverture liées à l' (aux) Opération(s) de Swap négociée(s) de gré à gré. Selon la (les) Convention(s) de Swap négociée(s) de gré à gré conclue(s) entre les Compartiments et la Contrepartie de Swap, les Compartiments recevront les performances de l'Indice de Référence ajustés afin de refléter certains coûts de réplification de l'indice associés, taxes et tout autre coût ou frais de transaction encourus par la Contrepartie de Swap relativement à l'Opération de Swap négociée de gré à gré. Ces coûts peuvent inclure, entre autres, les coûts, taxes ou autres droits en relation avec l'achat, la vente, la garde, la détention ou toute autre transaction en lien avec des Investissements dans des valeurs mobilières et/ou des Opérations de Swap négociées de gré à gré et/ou des garanties. La nature de ces coûts peut être différente en fonction de l'Indice de Référence dont le Compartiment vise à répliquer la performance.

•Situation 1 : l'Indice de Référence est « long » (à savoir que son objectif est de refléter la performance de ses composants). Dans ce cas, les coûts de réplification de l'indice seront associés (i) à l'achat et la vente par la Contrepartie de Swap des composants de l'Indice de Référence afin de répliquer leur performance ; ou (ii) aux frais de garde ou autres frais liés encourus par la Contrepartie de Swap en lien avec la détention des composants de l'Indice de Référence ; ou (iii) aux taxes ou autres obligations imposées sur l'achat ou la vente des composants de l'Indice de Référence ; ou (iv) aux taxes imposées sur tout revenu issu des composants des Indices de Référence ; ou (v) à toute autre transaction effectuée par la Contrepartie de Swap en lien avec les composants de l'Indice de Référence.

•Situation 2 : l'Indice de Référence est soumis à un « effet de levier » (à savoir que son objectif est de refléter la performance journalière avec effet de levier de la version longue de l'Indice de Référence). Dans ce cas, les coûts de réplification de l'indice seront associés (i) à l'achat, la vente et l'emprunt et/ou le financement par la Contrepartie de Swap des composants de l'Indice de Référence afin de répliquer leur performance ; ou (ii) aux frais de garde ou autres frais liés encourus par la Contrepartie de Swap en lien avec la détention des composants de l'Indice de Référence ; ou (iii) aux frais financiers encourus pour se protéger des mouvements du marché très importants des composants de l'Indice de Référence ; ou (iv) aux frais financiers inattendus liés aux mouvements de marché très importants ; ou (v) aux taxes imposées sur tout revenu issu des composants de l'Indice de Référence ; ou (vi) à toute autre transaction effectuée par la Contrepartie de Swap en lien avec les composants de l'Indice de Référence.

•Situation 3 : l'Indice de Référence est « court » (à savoir que son objectif consiste à refléter la performance inverse journalière de la version longue de l'Indice de Référence) ou « court et à effet de levier » (à savoir que son objectif consiste à refléter la performance inverse journalière de la version longue de l'Indice de Référence). Dans ce cas, les coûts de réplification de l'indice seront associés (i) à l'emprunt et/ou au financement par la Contrepartie de Swap des composants de l'Indice de Référence afin de répliquer sa performance, (ii) aux frais financiers encourus pour se protéger des mouvements du marché très importants des composants de l'Indice de Référence, (iii) aux frais financiers inattendus liés aux mouvements de marché très importants ou (iv) à toute autre transaction effectuée par la Contrepartie de Swap en lien avec les composants de l'Indice de Référence.

En outre, de temps à autre, chaque Contrepartie de Swap peut obtenir certains bénéfices ou bonifications du fait de ses activités de couverture. Dans certaines circonstances, la Contrepartie de Swap peut, à son gré, décider de verser tous ou certains de ces bénéfices ou bonifications au Compartiment dans le cadre de l'(des) Opération(s) de Swap négociée(s) de gré à gré en plus de tout paiement contractuel exigible en vertu de l'(des) Opération(s). Les Opérations de Swap négociées de gré à gré des Compartiments suivants ont été ajustées des valeurs ci-après dans le cadre de la valorisation de Swap prévalant au 30 juin 2020. Une valeur positive dans le tableau signifie que les Opérations de Swap négociées de gré à gré du Compartiment ont été soumises à un ajustement négatif. Ces valeurs sont déduites des bénéfices ou bonifications résultant des activités de couverture d'une Contrepartie de Swap, reçus dans le cadre de l'(des) Opération(s) de Swap négociée(s) de gré à gré, le cas échéant. Ces coûts peuvent varier de temps à autre en fonction de la conjoncture et des pratiques du marché.

Pendant la période clôturée le 30 juin 2020, les Opérations de Swap négociées de gré à gré des Compartiments n'ont fait l'objet d'aucune modification.

3. Détermination du Risque global

Pour tous les Compartiments, la méthodologie utilisée pour calculer le Risque global résultant de l'utilisation d'instruments financiers dérivés est la méthode du calcul de l'engagement, suivant la Circulaire 11/512 de la CSSF.

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires (suite)

4. Changements intervenus dans la composition du portefeuille d'investissements

Ces changements sont mis à la disposition des Actionnaires par le Dépositaire et l'Agent Administratif au siège social de la Société. Ils seront envoyés gratuitement à tout Actionnaire intéressé sur demande.

5. Autres événements significatifs au cours de la période

1. Au cours de l'exercice clos le 30 juin 2020, les Catégories d'Actions suivantes ont été lancées :

Compartiment	Catégorie d'Actions	ISIN	Date de lancement
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C-USD Hedged	LU2009147591	11 mars 2020
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2C	LU1920015440	11 mars 2020

2. Le 9 décembre 2019, la Société a informé les Actionnaires italiens que l'enregistrement des Catégories d'Actions suivantes à la Borsa Italiana sera annulé à compter du 10 mars 2020 :

Compartiment	Catégorie d'Actions/ Code ISIN
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C / LU0321463258
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D / LU0468896575
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D / LU0468897110
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C / LU0820950128

6. Événements ultérieurs

1. Le 27 février 2020, la Société a informé les Actionnaires de Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF de modifications importantes apportées à la méthodologie de son Indice de référence. Considérant les conditions de marché exceptionnelles, ces modifications ont été reportées et l'Agent Administratif de l'Indice, FTSE Fixed Income LLC, étalera les variations d'exposition correspondantes sur les rééquilibrages trimestriels de la période entre septembre 2020 et novembre 2020.

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires (suite)

7. Tableau des rendements et Écart de suivi

Le tableau ci-après contient les niveaux d'écart de suivi réalisés au cours de la période close le 30 juin 2020 pour tous les Compartiments et/ou toutes les Catégories d'Actions lancé(e)s avant le début de la période close le 30 juin 2020.

ISIN	Nom du Compartiment	Nom de la Catégorie d'Actions	Devise du Fonds	Devise de la Catégorie d'Actions	Commission globale max.	Performance de l'indice	Performance de la Catégorie d'Actions	Écart de performance	Différence de suivi	Écart de suivi
LU0290355717	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	2,04 %	1,97 %	-0,07 %	-0,08 %	0,01 %
LU0643975591	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,09 %	2,04 %	2,00 %	-0,04 %	-0,04 %	0,01 %
LU2009147591	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ^{(1),(2)}	EUR	USD	0,20 %	-1,54 %	-1,16 %	0,38 %	-0,08 %	0,01 %
LU0290356871	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	-0,16 %	-0,23 %	-0,07 %	-0,07 %	0,01 %
LU0614173549	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,15 %	-0,16 %	-0,23 %	-0,07 %	-0,07 %	0,01 %
LU0290356954	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	0,46 %	0,41 %	-0,05 %	-0,05 %	0,01 %
LU0614173895	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,15 %	0,46 %	0,41 %	-0,05 %	-0,05 %	0,01 %
LU0290357176	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	1,11 %	1,05 %	-0,06 %	-0,06 %	0,01 %
LU0290357259	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	2,02 %	1,95 %	-0,07 %	-0,07 %	0,02 %
LU0290357507	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	4,91 %	4,83 %	-0,08 %	-0,07 %	0,02 %
LU0290357846	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	7,58 %	7,48 %	-0,10 %	-0,09 %	0,02 %
LU0290357929	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR	EUR	0,25 %	3,88 %	5,57 %	1,69 %	-0,09 %	0,14 %
LU0962078753	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR	EUR	0,25 %	3,88 %	5,57 %	1,69 %	-0,09 %	0,14 %
LU0641007009	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽²⁾	EUR	USD	0,25 %	3,88 %	6,39 %	2,51 %	-0,09 %	0,14 %
LU0641007264	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged ⁽²⁾	EUR	GBP	0,25 %	3,88 %	5,97 %	2,09 %	-0,09 %	0,14 %
LU0641007421	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged ⁽²⁾	EUR	CHF	0,25 %	3,88 %	5,39 %	1,51 %	-0,09 %	0,14 %
LU0908508814	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	5C	EUR	EUR	0,20 %	3,88 %	3,79 %	-0,09 %	-0,09 %	0,14 %
LU0290358224	Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,20 %	-1,60 %	-1,72 %	-0,12 %	-0,12 %	0,36 %
LU0290358497	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,10 %	-0,23 %	-0,28 %	-0,05 %	-0,05 %	-
LU0335044896	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,10 %	-0,23 %	-0,28 %	-0,05 %	-0,05 %	-
LU0290358653	Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,18 %	-0,72 %	-0,81 %	-0,09 %	-0,09 %	0,01 %
LU0290359032	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,24 %	-5,69 %	-5,80 %	-0,11 %	-0,11 %	0,01 %
LU0321462870	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,24 %	3,06 %	2,94 %	-0,12 %	-0,12 %	0,01 %
LU0321462953	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽²⁾	USD	EUR	0,40 %	-5,12 %	-6,00 %	-0,88 %	0,05 %	0,48 %
LU1920015440	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2C(1)	USD	USD	0,25 %	1,04 %	0,95 %	-0,09 %	-0,09 %	0,52 %
LU0677077884	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	USD	USD	0,25 %	-5,12 %	-5,07 %	0,05 %	0,05 %	0,48 %
LU0321463258	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	-2,83 %	-2,91 %	-0,08 %	-0,07 %	0,01 %
LU0321463506	Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	1,20 %	1,13 %	-0,07 %	-0,08 %	0,01 %
LU0962081203	Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,15 %	1,20 %	1,13 %	-0,07 %	-0,08 %	0,01 %
LU0321465469	Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	USD	USD	0,15 %	0,34 %	0,26 %	-0,08 %	-0,08 %	0,01 %
LU0321464652	Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	GBP	GBP	0,15 %	0,16 %	0,09 %	-0,07 %	-0,07 %	0,01 %

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires (suite)

7. Tableau de performance et Écart de suivi (suite)

ISIN	Nom du Compartiment	Nom de la Catégorie d'Actions	Devise du Fonds	Devise de la Catégorie d'Actions	Commission globale max.	Performance de l'indice	Performance de la Catégorie d'Actions	Écart de performance	Différence de suivi	Écart de suivi
LU0378818131	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR	EUR	0,25 %	4,34 %	4,16 %	-0,18 %	-0,10 %	0,02 %
LU0690964092	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR	EUR	0,25 %	4,34 %	4,16 %	-0,18 %	-0,10 %	0,02 %
LU0641006290	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽²⁾	EUR	GBP	0,25 %	4,34 %	4,61 %	0,27 %	-0,10 %	0,02 %
LU0641006456	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3C - USD Hedged ⁽²⁾	EUR	USD	0,25 %	4,34 %	5,06 %	0,72 %	-0,10 %	0,02 %
LU0641006613	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged ⁽²⁾	EUR	CHF	0,25 %	4,34 %	3,95 %	-0,39 %	-0,10 %	0,02 %
LU0908508731	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	5C	EUR	EUR	0,20 %	4,34 %	4,23 %	-0,11 %	-0,10 %	0,02 %
LU0378818560	Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	SGD	SGD	0,20 %	6,78 %	6,66 %	-0,12 %	-0,12 %	0,03 %
LU0429459356	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	USD	USD	0,07 %	9,15 %	9,10 %	-0,05 %	-0,05 %	0,03 %
LU1399300455	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged ⁽²⁾	USD	EUR	0,10 %	9,15 %	8,18 %	-0,97 %	-0,05 %	0,03 %
LU0429458895	Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	USD	USD	0,07 %	2,95 %	2,92 %	-0,03 %	-0,04 %	0,01 %
LU0478205379	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,12 %	-1,19 %	-1,39 %	-0,20 %	-0,20 %	0,07 %
LU0643975161	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	2,27 %	2,19 %	-0,08 %	-0,07 %	0,01 %
LU0468896575	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,15 %	2,27 %	2,19 %	-0,08 %	-0,07 %	0,01 %
LU0468897110	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,15 %	-0,26 %	-0,33 %	-0,07 %	-0,07 %	0,01 %
LU0484968812	Xtrackers II ESG EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,16 %	-1,07 %	-1,20 %	-0,13 %	-0,13 %	0,07 %
LU0484969463	Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	2,29 %	2,22 %	-0,07 %	-0,07 %	0,01 %
LU0975326215	Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,15 %	2,29 %	2,22 %	-0,07 %	-0,08 %	0,01 %
LU0524480265	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	1,39 %	1,32 %	-0,07 %	-0,08 %	0,02 %
LU0962071741	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,15 %	1,39 %	1,32 %	-0,07 %	-0,08 %	0,02 %
LU0494592974	Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	AUD	AUD	0,25 %	4,10 %	3,96 %	-0,14 %	-0,14 %	0,04 %
LU0613540268	Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	-	-0,08 %	-0,08 %	-0,08 %	0,04 %
LU0820950128	Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,20 %	2,09 %	1,99 %	-0,10 %	-0,10 %	0,02 %
LU0925589839	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,15 %	0,06 %	-0,02 %	-0,08 %	-0,08 %	0,02 %
LU0975334821	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,15 %	0,06 %	-0,02 %	-0,08 %	-0,08 %	0,02 %
LU0952581584	Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	JPY	JPY	0,15 %	-1,23 %	-1,30 %	-0,07 %	-0,07 %	0,01 %
LU0942970103	Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	1D	USD	USD	0,15 %	2,98 %	2,90 %	-0,08 %	-0,08 %	0,01 %
LU0942970285	Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	2C - USD Hedged	USD	USD	0,20 %	3,90 %	3,79 %	-0,11 %	-0,08 %	0,01 %
LU0942970368	Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	3D - GBP Hedged	USD	GBP	0,20 %	3,51 %	3,41 %	-0,10 %	-0,08 %	0,01 %
LU0942970442	Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	4C - CHF Hedged	USD	CHF	0,20 %	2,87 %	2,77 %	-0,10 %	-0,08 %	0,01 %
LU0942970798	Xtrackers II GLOBAL AGGREGATE BOND SWAP UCITS ETF	5C - EUR Hedged	USD	EUR	0,20 %	3,10 %	2,99 %	-0,11 %	-0,08 %	0,01 %
LU1109943388	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	EUR	EUR	0,20 %	-5,40 %	-5,51 %	-0,11 %	-0,10 %	0,78 %
LU1109942653	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,20 %	-5,40 %	-5,51 %	-0,11 %	-0,11 %	0,78 %
LU1109939865	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	EUR	EUR	0,35 %	-4,75 %	-4,92 %	-0,17 %	-0,17 %	0,02 %

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires (suite)

7. Tableau de performance et Écart de suivi (suite)

ISIN	Nom du Compartiment	Nom de la Catégorie d'Actions	Devise du Fonds	Devise de la Catégorie d'Actions	Commission globale max.	Performance de l'indice	Performance de la Catégorie d'Actions	Écart de performance	Différence de suivi	Écart de suivi
LU1094612022	Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	USD	USD	0,40 %	1,30 %	0,95 %	-0,35 %	-0,35 %	0,86 %
LU1409136006	Xtrackers II USD ASIA EX JAPAN CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	USD	USD	0,30 %	3,66 %	3,04 %	-0,62 %	-0,62 %	1,26 %

⁽¹⁾ Catégorie d'Actions lancée le 11 mars 2020. Veuillez vous reporter au point 1 de la section des autres événements significatifs sur la période des notes aux États Financiers du présent rapport semestriel pour de plus amples informations.

⁽²⁾ Catégories d'Actions à couverture de change à réplique directe :
 « L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'Actions couverte en devise de ce Compartiment et l'Indice de Référence sans couverture » ;
 « La différence de suivi est définie comme la différence entre la performance de la Catégorie d'Actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de Référence sans couverture » ;
 « L'Écart de suivi est défini comme la différence entre la volatilité de la catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'indice de référence sans couverture ».