

La fiche d'information est datée du 28 mars 2024 sauf mention contraire.

# Xtrackers II iTraxx Crossover Short Daily Swap UCITS ETF 1C

un compartiment de Xtrackers II

## En bref

- Exposition aux credit default swap (CDS) appartenant à l'indice iTraxx sous-jacent
- CDS sur des entreprises notées "High yield"

## Caractéristiques clés de l'index de référence

L'indice Markit iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX vise à refléter la performance du marché suivant :

- CDS courts de 5 ans émanant d'entités européennes (exposition de crédit pure, position CDS financée)
- Sociétés autres que « investment grade » uniquement
- Les entités de référence qui sont éligibles affichent un écart équivalent au moins à deux fois l'écart moyen des composants de l'indice iTraxx Non-Financial Index.
- 75 entités européennes sur la base du meilleur classement par la liquidité
- Tous les composants ont une pondération équivalente.

La performance de cet indice repose sur trois facteurs : moins le rendement courant des CDS (portage), moins l'évolution des cours des CDS et le rendement courant de la composante financement (taux Euro short term).

Des informations supplémentaires sur l'Indice et la méthodologie générale à l'origine des indices iTraxx sont disponibles sur le site Internet de Markit iBoxx ([www.markit.com](http://www.markit.com)).

## Qualités des Exchange Traded Funds

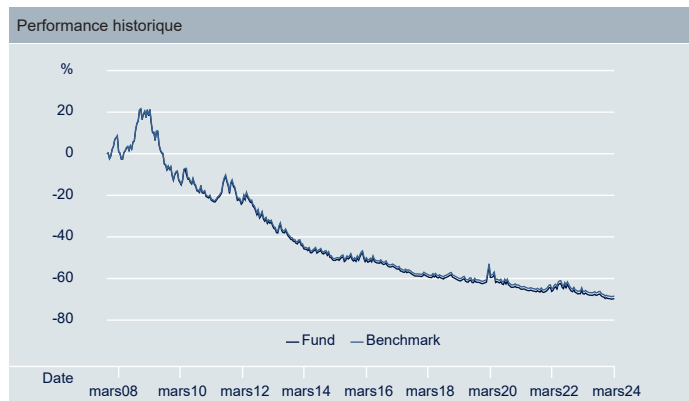
- **La valeur de votre investissement peut évoluer à la baisse comme à la hausse et les performances passées ne prédisent pas les rendements futurs. Le capital des investisseurs peut être en danger jusqu'à concurrence d'une perte totale.**
- Le Fonds est exposé aux fluctuations du marché d'actions d'un seul pays ou d'une seule région, où des développements politiques ou économiques, des actes gouvernementaux ou des catastrophes naturelles peuvent avoir des effets négatifs auxquels ne sont pas soumis les Fonds investissant sur des marchés plus diversifiés.
- Le Fonds souscrit un produit dérivé avec une contrepartie. Si la contrepartie est en défaut de paiement (en cas d'insolvabilité, par exemple), votre investissement risque de subir une perte.
- L'Indice est conçu pour refléter la performance d'une position négative (« courte ») par rapport à l'Indice sous-jacent, de sorte que le niveau de l'Indice doit augmenter lorsque l'Indice sous-jacent diminue et diminuer lorsque l'Indice sous-jacent augmente. L'Indice est conçu pour suivre cet objectif chaque jour, ce qui ne doit pas s'assimiler à une recherche de positions courtes sur des périodes de plus d'un jour. La performance du Fonds sur des périodes de plus d'un jour peut ne pas être inversement proportionnelle ou symétrique aux rendements de l'Indice sous-jacent.
- L'Indice présente une exposition notionnelle sur la valeur et/ou sur le rendement de certains dérivés de crédit qui peuvent évoluer à la baisse. Les marchés liés à ces Parts peuvent parfois devenir volatils ou illiquides. L'Indice peut être affecté.

Informations sur le fonds	
ISIN	LU0321462870
Devise de la Part	EUR
Fund Currency	EUR
Date de lancement du Fonds	07 novembre 2007
Domicile	Luxembourg
Méthodologie du portefeuille	Panier de Substitution + Swap de Performance
Sous-gestionnaire de portefeuille	DWS Investments UK Ltd
Gestionnaire d'investissement	DWS Investments UK Ltd
Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Frais annuels maximum <sup>1</sup>	0,24% p.a.
Traitement des revenus	réinvestis
Couverture de devises	Non
Contreparties de swap actives	Deutsche Bank AG
VNI par action	EUR 31,49
Encours	EUR 28,45 Million
Nombre total de titres en circulation	903 656,00
Index Name	Markit iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX

<sup>1</sup> Veuillez consulter les informations supplémentaires / glossaire.

Cotations et transactions			
Bourse	Code Bloomberg	Code Reuters	Devise
XETRA	XTC5 GY	XTC5.DE	EUR
Borsa Italiana	XTC5 IM	XTC5.MI	EUR

Chiffres de performance cumulée						
	1 Month	3 Months	6 Months	1 Year	3 ans	Volatilité annualisée
Part	-0,18%	-0,29%	-5,44%	-7,54%	-13,79%	8,29%
Index	-0,16%	-0,23%	-5,33%	-7,32%	-13,18%	8,23%
Écart de suivi	-0,02%	-0,06%	-0,11%	-0,22%	-0,61%	-
Erreur de suivi	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	-



Source: DWS, fournisseur de l'indice

Chiffres de performance de l'année civile						
	2019	2020	2021	2022	2023	Depuis le début d'année
Part	-9,52%	-4,79%	-7,01%	2,02%	-10,89%	-0,29%
Indice	-9,30%	-4,56%	-6,78%	2,26%	-10,68%	-0,23%
Écart de suivi	-0,22%	-0,23%	-0,23%	-0,24%	-0,21%	-0,06%
Erreur de suivi	0,19%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%

Chiffres de performance glissante												
	3/14 - 3/15	3/15 - 3/16	3/16 - 3/17	3/17 - 3/18	3/18 - 3/19	3/19 - 3/20	3/20 - 3/21	3/21 - 3/22	3/22 - 3/23	3/23 - 3/24	Depuis le lancement	
Part	-10,47%	-1,04%	-7,49%	-8,35%	-3,78%	8,58%	-18,06%	-3,15%	-3,73%	-7,54%	-6,96%	
Indice	-10,25%	-0,80%	-7,26%	-8,13%	-3,55%	8,84%	-17,86%	-2,92%	-3,50%	-7,32%	-6,73%	
Écart de suivi	-0,22%	-0,24%	-0,23%	-0,22%	-0,23%	-0,26%	-0,20%	-0,23%	-0,22%	-0,22%	-0,08%	
Erreur de suivi	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,20%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,54%	

La fiche d'information est datée du 28 mars 2024 sauf mention contraire.

Informations sur l'indice	
Index Name	Markit iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX
Index Provider	Markit Indices Limited
Bloomberg Symbol	ITRXXS5I
Type d'indice	Brut de rendement total
Devise de base de l'indice	EUR
Nombre de constituants de l'indice	75
Fréquence de rééquilibrage de l'indice	Semestriel
Current Spread (in bps)	562

Source: Fournisseur d'indices

### Informations Xtrackers

DWS International GmbH, Paris Branch | Info: [etf.Xtrackers.com](mailto:etf.Xtrackers.com)  
 Xtrackers Team | E-Mail: [xtrackers@dws.com](mailto:xtrackers@dws.com)  
 Avenue Franklin D. Roosevelt 23-25  
 75008 Paris  
 France

Components of the Markit iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX					
Reference Entity	Spread in BP	Reference Entity	Spread in BP	Reference Entity	Spread in BP
ATOS SE 11/28 AV387914	18 235	Novafives S.A.S. 6/25	332	Constellium NV 2/26	172
Intrum Justitia AB 7/24	1 662	BBG012V24F52 ILIAD HOLDING SAS SR SECURED REGS 10/28 5.625 10/28	328	VOLVO CAR AB	171
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 1.750% 2025-01-14	1 449	CW Sr Fin Ltd	312	UPC Holding B.V.	171
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 5/24	1 296	Ziggo Bond Finance BV 1/25	306	Premier Foods Finance PLC	169
Numericable Group SA 5/24	876	CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH	304	SCHAEFFLER AG 03/24 AX751866	163
ADLER Real Estate AG 12/21	728	BBG0152D25Y5 ALLWYN ENTERTAINMENT FIN 02/28 1 2/28	292	ThyssenKrupp AG 2/25	160
Boparan Finance PLC	581	METRO AG 10/21 EUR33459	292	DUFREY ONE BV	152
Iceland Bondco PLC	555	BBG012R3Z7K2 KAIXO BONDSCO TELECOM SAU 9/29	291	RENAULT 3/21	144
3.25 Bellis26Nts -S	524	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	288	AUTOSTRADA SPA 02/25 EUR54744	144
EG GLOBAL FINANCE PLC SR SECURED REGS 10/25 6.25	523	BBG014LLWV97 WEBUILD SPA 7/26	270	Nidda Healthcare Holding GmbH 9/24	139
Altice Finco S.A.	523	EP INFRASTRUCTURE AS 1.659% 2024-04-26	252	Crown European Holdings SA 5/25	136
BBG00YZ4R632 INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 1/26	508	BBG0100PWW51 NEXI SPA 4/26	251	Cleopatra Finance Ltd 2/23	126
Grifols SA 5/25	502	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC	244	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE ORD SHS	118
MOTION BONDSCO DAC SR SECURED REGS 11/27 4.5	494	3.15 TECHNIP 23	242	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 0.25% 06/09/2024 9/24	117
Stonegate Pub Company Financing PLC	473	PIRELLI/FORVIA/TESLA	238	Cellnex Telecom SA 7/22	115
INEOS Group Holdings SA 8/24	418	Hapag-Lloyd AG 7/24	229	ERICSSON LM 05/22	114
CITYCON TREASURY BV 09/26 EUR52987	406	Stena Aktiebolag	226	Rexel SA 6/25	106
VERTICAL HOLDCO GMBH 7/28	406	Matterhorn Telecom Holding SA 5/23	215	Elis 4/24	106
Loxam SAS 4/25	398	Saipem Finance International BV 9/23	214	BBG00NSG83Y1	105
Monitchem Holdco 3 S.A.	389	OI European Group BV 11/24	213	MARKS & SPENCER PLC 12/23 GBP07940	100
TUI AG 10/21	360	VALEO SA 01/24	210	Nokia OYJ 3/21	95
Picard Bondco SA 11/24	351	AIR FRANCE - KLM	206	ROLLS-ROYCE PLC 06/21	91
BBG00YVS6VX8 VERISURE MIDHOLDING AB 2/29	349	ZF EUROPE FINANCE BV	188	PPF TELECOM GROUP BV 5/24	89
United Group BV 7/22	342	Telecom Italia SpA 1/24	183	ACCOR SA 02/21	73
Cirsa Finance International Sarl 5/25	334	INTL CONSOLIDATED AIRLINES GRP ORD	179	GKN HOLDINGS PLC 09/22 GBP04640	57

Source: fournisseur de l'indice; as at 29 février 2024

### Information Additionnelle

Veillez trouver un Glossaire sur [etf.dws.com](http://etf.dws.com).

La performance de l'ETF est présentée sur la base de la VL, nette de frais et de coûts de réplcation de l'indice. La Performance de l'Indice est calculée sur la base du rendement total. La volatilité est calculée depuis le lancement de la catégorie d'actions.

### Avertissement relatif au fonds

Ce document est destiné à la communication marketing et ne crée aucune obligation juridiquement contraignante pour DWS Group GmbH & Co. KGaA et/ou de ses filiales (DWS). Ce document ne constitue pas un conseil en investissement. Sans limitation, ce document ne constitue pas une offre, une invitation à offrir ou une recommandation à conclure une quelconque transaction. Avant de prendre une décision d'investissement, les investisseurs doivent examiner, avec ou sans l'aide d'un conseiller en investissement, si les investissements et les stratégies décrits ou fournis par DWS sont appropriés à la lumière de leurs besoins d'investissement particuliers, de leurs objectifs et de leur situation financière.

Les informations contenues dans le présent document ont été obtenues ou dérivées de sources considérées comme fiables et actuelles. Toutefois, l'exactitude et l'exhaustivité des sources ne peuvent être garanties. Selon les informations contenues dans le prospectus de vente, la distribution des produits mentionnés dans ce document est soumise aux restrictions des juridictions concernées. Ce document et les informations qu'il contient ne peuvent être distribués et publiés que dans les juridictions où cette distribution et cette publication sont autorisées par la loi applicable dans ces juridictions. La distribution directe ou indirecte de ce document est interdite aux Etats-Unis ainsi qu'aux personnes américaines et aux personnes résidant aux Etats-Unis ou pour leur compte.

Xtrackers II est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) conformément aux lois et réglementations applicables. Il a été créé en tant que société d'investissement à capital variable et à responsabilité séparée entre ses compartiments respectifs.

Les investisseurs doivent acheter et généralement vendre des actions des Xtrackers UCITS ETF sur un marché secondaire avec l'aide d'un intermédiaire (par exemple, un courtier en valeurs mobilières) et peuvent encourir des frais pour ce faire. En outre, les investisseurs peuvent payer plus que la valeur nette d'inventaire actuelle lorsqu'ils achètent des actions et peuvent recevoir moins que la valeur nette d'inventaire actuelle lorsqu'ils les vendent. Avant de prendre une décision d'investissement, les investisseurs doivent se référer aux facteurs de risque figurant dans le prospectus et le document d'informations clés.

Le traitement fiscal des Xtrackers UCITS ETF dépend de la situation individuelle de chaque investisseur. Xtrackers II est une société constituée au Grand-Duché de Luxembourg, inscrite au registre du commerce et des sociétés de Luxembourg sous le numéro B-124.284 et dont le siège social est situé 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg. DWS Investment S.A. agit en tant que société de gestion de Xtrackers II. La SICAV peut décider de mettre fin aux accords conclus pour la commercialisation de ce fonds.

Des informations complètes sur le fonds, y compris les risques et les coûts, sont disponibles dans le prospectus et les documents d'informations clés correspondant, ils constituent les seuls documents de vente contraignants pour le Fonds. Les investisseurs peuvent obtenir ces documents, ainsi que des informations réglementaires et les derniers documents constitutifs du Fonds en allemand auprès de DWS Investment GmbH, Mainzer Landstraße 11-17, 60329 Francfort-sur-le-Main, ou en anglais auprès de DWS Investment S.A., 2, Boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxembourg, sous forme imprimée et sans frais, ou dans les langues respectives en Allemagne : <https://etf.dws.com/de-de/> Autriche : <https://etf.dws.com/de-at/> Belgique : <https://etf.dws.com/en-be/> France : <https://etf.dws.com/fr-fr/> Italie : <https://etf.dws.com/it-it/> Luxembourg : <https://etf.dws.com/en-lu/> Espagne : <https://etf.dws.com/es-es/> Pays-Bas : <https://etf.dws.com/nl-nl/> Suède : <https://etf.dws.com/sv-se/> et Royaume-Uni/Irlande : <https://etf.dws.com/en-gb/>. Un résumé des droits des investisseurs est disponible à l'adresse [www.etf.dws.com](http://www.etf.dws.com) sous la rubrique "A propos de nous - Comment porter plainte?". **LES PERFORMANCES PASSES NE GARANTISSENT PAS LES RESULTATS FUTURS**

© 2024 DWS International GmbH, agissant par l'intermédiaire de ses succursales, le cas échéant.

### Mentions légales concernant l'indice

L'Indice et les marques de commerce dans les présentes sont la propriété intellectuelle de Markit Indices Limited et/ou de ses concédants de licence (« Markit ») et sont utilisés sous licence par Markit. Le Fonds n'est nullement cautionné, garanti, vendu ou promu par Markit. Markit ne formule aucune garantie ou déclaration implicite ou explicite quant à l'exactitude, à l'adaptation pour un usage particulier ou aux résultats obtenus de l'utilisation de l'Indice et sa responsabilité ne peut être engagée à cet égard. La clause de non-responsabilité complète est disponible dans le prospectus du Fonds