

Xtrackers II

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

Rapport annuel et États financiers audités pour l'exercice clos le 31 décembre 2023

Aucune souscription ne peut être reçue sur la base des présents 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	4
Rapport des Administrateurs	6
Rapport du contrôleur de comptes	18
Statistiques	23
État de l'actif net au 31 décembre 2023	27
État des opérations et Variations de l'actif net pour l'exercice clos le 31 décembre 2023	41
État des variations des Actions émises pour l'exercice clos le 31 décembre 2023	55
État des portefeuilles au 31 décembre 2023	59
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	59
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	72
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	74
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	76
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	78
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	80
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	82
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	84
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	89
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	91
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	93
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	95
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	109
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	110
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	111
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	112
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	113
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	138
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	139
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	146
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	149
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	240
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	243
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	244
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	307
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	308
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	313
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	314
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	315
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	316
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	318
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	324
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	444
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	461
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	464
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	467
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	515
Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	538
Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	546
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	548
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	549
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	561
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽¹⁾	569
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF ⁽¹⁾	572
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽¹⁾	573
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	574

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Sommaire (suite)

	<u>Page</u>
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	582
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	589
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	595
Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF ⁽¹⁾	599
Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF ⁽¹⁾	602
Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF ⁽¹⁾	603
Notes aux États financiers	605
Informations destinées aux Actionnaires - non auditées	655
Publication périodique pour les produits visés aux Articles 8 et 9 dans le cadre du SFDR et du Règlement européen sur la taxinomie - non auditée	675

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Organisation

<p>Siège social Xtrackers II 49, avenue J. F. Kennedy L-1855 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg</p>
<p>Conseil d'administration</p> <ul style="list-style-type: none"> - Alfred François Brausch Membre du barreau de Luxembourg, administrateur indépendant, 35, avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg. - Thilo Wendenburg Administrateur indépendant, DWS Investment S.A., 2, boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg. - Philippe Ah-Sun Directeur mondial de la division Passive Operations chez DWS Investments UK Limited, 21 Moorfields, Londres, EC2Y 9DB, Royaume-Uni. - Julien Boulliat Directeur de la division Portfolio Engineering Systematic Investment Solutions chez DWS Investments UK Limited, 21 Moorfields, Londres, EC2Y 9DB, Royaume-Uni - Michael Mohr⁽¹⁾ Directeur mondial de la division Passive Product Specialists chez DWS International GmbH, Mainzer Landstrasse 11-17, Francfort-sur-le-Main 60329, Allemagne. - Stefan Kreuzkamp⁽²⁾ Administrateur externe, DWS Investment S.A., 2, boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg.
<p>Dépositaire State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg 49, avenue J. F. Kennedy L-1855 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg</p>
<p>Société de gestion DWS Investment S.A. 2, boulevard Konrad Adenauer L-1115 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg</p>
<p>Agent administratif, Agent payeur, Agent domiciliataire et Agent de cotation State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg 49, avenue J. F. Kennedy L-1855 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg</p>
<p>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</p>

⁽¹⁾ Michael Mohr a démissionné de ses fonctions d'Administrateur à compter du 21 mars 2023. En conséquence, Michael Mohr n'est plus membre du Conseil d'administration depuis la date susmentionnée.

⁽²⁾ Stefan Kreuzkamp a été nommé Administrateur à compter du 21 avril 2023.

<p>Gestionnaires d'investissement/Gestionnaires de portefeuille délégués de certains Compartiments (voir Note 12)</p> <p>DWS Investments UK Limited 21 Moorfields, Londres, EC2Y 9DB⁽³⁾ Royaume-Uni</p> <p>DWS Investment GmbH Mainzer Landstrasse 11-17 60329 Francfort-sur-le-Main Allemagne</p> <p>DWS Investments Hong Kong Limited 60/F, International Commerce Centre 1 Austin Road West, Kowloon Hong Kong</p> <p>DWS Investment Management Americas, Inc. 345 Park Avenue, New York, NY 10154 États-Unis d'Amérique</p> <p>Harvest Global Investments Limited 31/F, One Exchange Square 8 Connaught Place, Central Hong Kong</p>
<p>Services de prêt de titres de certains Compartiments (voir Note 8)</p> <p>DWS Investment GmbH Mainzer Landstrasse 11-17 60329 Francfort-sur-le-Main Allemagne</p>
<p>Contrôleur de comptes de la Société</p> <p>KPMG Audit S.à r.l. 39, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg</p>
<p>Conseillers juridiques de la Société</p> <p>Elvinger Hoss Prussen <i>société anonyme</i> 2, place Winston Churchill L-1340 Luxembourg Grand-Duché de Luxembourg</p>

Les termes en majuscule dans ce document ont la même signification que dans le prospectus de Xtrackers II applicable au 31 décembre 2023 (le « Prospectus »), à moins que le contexte ne s'y oppose.

⁽³⁾Jusqu'au 1^{er} février 2024, l'adresse était Winchester House, 1 Great Winchester Street, Londres, EC2N 2DB, Royaume-Uni.

Données de performance des Catégories d'actions pour l'exercice 2023

Les données de performance dans le rapport des Administrateurs sont calculées sur la base de la dernière VL officielle publiée pour l'exercice 2023, qui peut différer dans certains cas de la VL utilisée aux fins du rapport annuel. Les VL utilisées pour le rapport annuel sont toutes datées du 31/12/2023 (à l'exception de celles des Compartiments ou Catégories d'actions liquidés), et ont été calculées spécifiquement pour le rapport annuel. Afin d'éviter toute ambiguïté, les VL publiées dans le rapport annuel ne sont pas les VL utilisées pour les négociations de tout Actionnaire. Le calcul des données de performance avec la VL figurant dans le rapport annuel produira des résultats différents de ceux du tableau.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Devise du compartiment/ Devise de la Catégorie d'actions	Commission globale maximale	Performance de l'indice en 2023	Performance de la Catégorie d'actions en 2023	Écart de performance (Performance Difference)/ Différence de suivi (Tracking Difference)
Stratégies portant sur des liquidités							
LU0290358497	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,10 %	3,37 %	3,27 %	-0,10 %/ -0,10 %
LU0335044896	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,10 %	3,37 %	3,27 %	-0,10 %/ -0,10 %
LU0321465469	Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	USD/ USD	0,10 % ⁽¹⁾	5,21 %	5,06 %	-0,15 %/ -0,14 %
LU0321464652	Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	GBP/ GBP	0,10 % ⁽¹⁾	4,69 %	4,55 %	-0,14 %/ -0,14 %
Stratégies portant sur les obligations souveraines et sécurisées							
LU0290355717	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,09 % ⁽¹⁾	7,15 %	7,06 %	-0,09 %/ -0,09 %
LU0643975591	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,09 %	7,15 %	7,12 %	-0,03 %/ -0,03 %
LU2009147591	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽²⁾	EUR/ USD	0,20 %	7,15 %	9,29 %	2,14 %/ -0,09 %
LU2523866023	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽²⁾	EUR/ GBP	0,20 %	7,15 %	8,44 %	1,29 %/ -0,09 %
LU0290356871	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	3,53 %	3,43 %	-0,10 %/ -0,10 %
LU0614173549	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,15 %	3,53 %	3,43 %	-0,10 %/ -0,10 %
LU0290356954	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	5,70 %	5,65 %	-0,05 %/ -0,05 %
LU0614173895	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,15 %	5,70 %	5,65 %	-0,05 %/ -0,05 %

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le taux de commission de cette Catégorie d'actions a changé. Veuillez vous reporter à la section relative aux événements significatifs au cours de l'exercice des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽²⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

« La Différence de suivi (Tracking Difference) est définie comme la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Devise du compartiment/ Devise de la Catégorie d'actions	Commission globale maximale	Performance de l'indice en 2023	Performance de la Catégorie d'actions en 2023	Écart de performance (Performance Différence)/ Différence de suivi (Tracking Difference)
Stratégies portant sur les obligations souveraines et sécurisées (suite)							
LU2606231335	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2C - USD Hedged ^{(2),(3)}	EUR/ USD	0,20 %	3,43 %	4,58 %	1,15 %/ -0,03 %
LU2606231418	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2D - GBP Hedged ^{(2),(3)}	EUR/ GBP	0,20 %	3,43 %	4,26 %	0,83 %/ -0,03 %
LU0290357176	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	7,18 %	7,10 %	-0,08 %/ -0,08 %
LU0290357259	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	9,12 %	9,07 %	-0,05 %/ -0,05 %
LU2523865728	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1D - GBP Hedged ⁽²⁾	EUR/ GBP	0,20 %	9,12 %	10,50 %	1,38 %/ -0,05 %
LU2523865991	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽²⁾	EUR/ USD	0,20 %	9,12 %	11,40 %	2,28 %/ -0,05 %
LU0290357507	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	10,62 %	10,49 %	-0,13 %/ -0,13 %
LU0290357846	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	10,59 %	10,46 %	-0,13 %/ -0,14 %
LU0321462953	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽²⁾	USD/ EUR	0,40 %	11,11 %	8,05 %	-3,06 %/ -0,31 %
LU2361257269	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽²⁾	USD/ EUR	0,40 %	11,11 %	7,95 %	-3,16 %/ -0,31 %
LU1920015440	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2C	USD/ USD	0,25 %	11,11 %	10,81 %	-0,30 %/ -0,30 %
LU0677077884	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	USD/ USD	0,25 %	11,11 %	10,79 %	-0,32 %/ -0,31 %
LU0321463258	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	-1,22 %	-1,37 %	-0,15 %/ -0,15 %
LU0321463506	Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	5,46 %	5,30 %	-0,16 %/ -0,16 %

⁽²⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

« La Différence de suivi (Tracking Difference) est définie comme la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽³⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Devise du compartiment/ Devise de la Catégorie d'actions	Commission globale maximale	Performance de l'indice en 2023	Performance de la Catégorie d'actions en 2023	Écart de performance (Performance Différence)/ Différence de suivi (Tracking Difference)
Stratégies portant sur les obligations souveraines et sécurisées (suite)							
LU0378818131	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR/ EUR	0,25 %	1,57 %	3,83 %	2,26 %/ -0,16 %
LU0690964092	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR/ EUR	0,25 %	1,57 %	3,85 %	2,28 %/ -0,16 %
LU0641006290	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽²⁾	EUR/ GBP	0,25 %	1,57 %	5,25 %	3,68 %/ -0,16 %
LU0641006456	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3C - USD Hedged ⁽²⁾	EUR/ USD	0,25 %	1,57 %	6,12 %	4,55 %/ -0,16 %
LU0641006613	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged ⁽²⁾	EUR/ CHF	0,25 %	1,57 %	1,69 %	0,12 %/ -0,16 %
LU0908508731	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	5C	EUR/ EUR	0,20 %	1,57 %	1,41 %	-0,16 %/ -0,16 %
LU0378818560	Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	SGD/ SGD	0,20 %	3,67 %	3,44 %	-0,23 %/ -0,23 %
LU1920015796	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1C	USD/ USD	0,06 % ⁽¹⁾	4,11 %	4,17 %	0,06 %/ 0,06 %
LU0429459356	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	USD/ USD	0,06 % ⁽¹⁾	4,11 %	4,17 %	0,06 %/ 0,06 %
LU2610432036	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2C - GBP Hedged ^{(2),(3)}	USD/ GBP	0,10 %	0,37 %	-0,02 %	-0,39 %/ 0,06 %
LU1399300455	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged ⁽²⁾	USD/ EUR	0,10 %	4,11 %	1,91 %	-2,20 %/ 0,06 %
LU1920015523	Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1C	USD/ USD	0,06 % ⁽¹⁾	4,32 %	4,28 %	-0,04 %/ -0,04 %
LU0429458895	Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	USD/ USD	0,06 % ⁽¹⁾	4,32 %	4,28 %	-0,04 %/ -0,04 %
LU0643975161	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	5,62 %	5,51 %	-0,11 %/ -0,11 %
LU0468896575	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,15 %	5,62 %	5,51 %	-0,11 %/ -0,11 %
LU2523866379	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽²⁾	EUR/ USD	0,20 %	5,62 %	7,70 %	2,08 %/ -0,11 %
LU2523866296	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽²⁾	EUR/ GBP	0,20 %	5,62 %	7,19 %	1,57 %/ -0,11 %
LU0468897110	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,15 %	2,81 %	2,68 %	-0,13 %/ -0,13 %

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le taux de commission de cette Catégorie d'actions a changé. Veuillez vous reporter à la section relative aux événements significatifs au cours de l'exercice des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽²⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

« La Différence de suivi (Tracking Difference) est définie comme la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽³⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Devise du compartiment/ Devise de la Catégorie d'actions	Commission globale maximale	Performance de l'indice en 2023	Performance de la Catégorie d'actions en 2023	Écart de performance (Performance Différence)/ Différence de suivi (Tracking Difference)
Stratégies portant sur les obligations souveraines et sécurisées (suite)							
LU0484969463	Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	5,76 %	5,64 %	-0,12 %/ -0,12 %
LU0524480265	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	8,27 %	8,11 %	-0,16 %/ -0,16 %
LU0962071741	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,15 %	8,27 %	8,11 %	-0,16 %/ -0,16 %
LU0494592974	Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	AUD/ AUD	0,25 %	4,74 %	4,45 %	-0,29 %/ -0,29 %
LU0613540268	Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	3,13 %	3,01 %	-0,12 %/ -0,12 %
LU0820950128	Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,20 %	6,11 %	5,89 %	-0,22 %/ -0,22 %
LU0925589839	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	3,96 %	3,80 %	-0,16 %/ -0,16 %
LU2552296563	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D ⁽³⁾	EUR/ EUR	0,15 %	3,20 %	3,05 %	-0,15 %/ -0,15 %
LU0952581584	Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	JPY/ JPY	0,15 %	0,48 %	0,33 %	-0,15 %/ -0,15 %
LU0942970103	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	USD/ USD	0,10 %	5,92 %	5,77 %	-0,15 %/ -0,15 %
LU0942970285	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽²⁾	USD/ USD	0,10 % ⁽¹⁾	5,92 %	6,69 %	0,77 %/ -0,15 %
LU0942970368	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged ⁽²⁾	USD/ GBP	0,10 % ⁽¹⁾	5,92 %	5,92 %	0,00 %/ -0,15 %
LU0942970442	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged ⁽²⁾	USD/ CHF	0,10 % ⁽¹⁾	5,92 %	2,30 %	-3,62 %/ -0,15 %
LU0942970798	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	5C - EUR Hedged ⁽²⁾	USD/ EUR	0,10 % ⁽¹⁾	5,92 %	4,43 %	-1,49 %/ -0,15 %
LU1094612022	Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	USD/ USD	0,20 %	1,71 %	1,45 %	-0,26 %/ -0,26 %

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le taux de commission de cette Catégorie d'actions a changé. Veuillez vous reporter à la section relative aux événements significatifs au cours de l'exercice des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽²⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de performance (Performance Difference) est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

« La Différence de suivi (Tracking Difference) est définie comme la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽³⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Devise du compartiment/ Devise de la Catégorie d'actions	Commission globale maximale	Performance de l'indice en 2023	Performance de la Catégorie d'actions en 2023	Écart de performance (Performance Difference)/ Différence de suivi (Tracking Difference)
Stratégies portant sur les obligations souveraines et sécurisées (suite)							
LU2462217071	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,20 %	3,15 %	2,94 %	-0,21 %/ -0,21 %
LU2385068163	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,20 %	3,15 %	2,93 %	-0,22 %/ -0,21 %
LU2385068247	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽²⁾	EUR/ GBP	0,25 %	3,15 %	5,46 %	2,31 %/ -0,21 %
LU2385068320	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged ⁽²⁾	EUR/ USD	0,25 %	3,15 %	6,27 %	3,12 %/ -0,21 %
LU2385068593	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR/ EUR	0,25 %	3,15 %	3,98 %	0,83 %/ -0,21 %
LU2468423459	Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	6,32 %	6,17 %	-0,15 %/ -0,15 %
LU2504532487	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,18 %	9,53 %	9,38 %	-0,15 %/ -0,15 %
LU2504537445	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,12 %	6,94 %	6,82 %	-0,12 %/ -0,12 %
LU2158769930	Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF ⁽⁵⁾	1D	USD/ USD	0,25 %	6,67 %	7,03 %	0,36 %/ 0,36 %
LU2641054122	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽⁵⁾	1C	EUR/ EUR	0,07 %	1,10 %	1,12 %	0,02 %/ 0,02 %
LU2641053827	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF ⁽⁵⁾	1C	EUR/ EUR	0,07 %	1,13 %	1,16 %	0,03 %/ 0,03 %
LU2641054551	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽⁵⁾	1C	EUR/ EUR	0,07 %	1,01 %	1,02 %	0,01 %/ 0,01 %
LU2662649503	Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF ⁽⁵⁾	1D	USD/ USD	0,06 %	1,60 %	1,60 %	0,00 %/ 0,00 %
LU2662649685	Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF ⁽⁵⁾	1D	USD/ USD	0,06 %	2,28 %	2,29 %	0,01 %/ 0,01 %
LU2662649412	Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF ⁽⁵⁾	1D	USD/ USD	0,06 %	3,85 %	3,86 %	0,01 %/ 0,01 %

⁽²⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de performance (Performance Difference) est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

« La Différence de suivi (Tracking Difference) est définie comme la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽⁵⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Devise du compartiment/ Devise de la Catégorie d'actions	Commission globale maximale	Performance de l'indice en 2023	Performance de la Catégorie d'actions en 2023	Écart de performance (Performance Difference)/ Différence de suivi (Tracking Difference)
Stratégies liées à l'inflation							
LU0290357929	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR/ EUR	0,25 %	1,91 %	2,01 %	0,10 %/ -0,07 %
LU0962078753	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽²⁾	EUR/ EUR	0,20 % ⁽¹⁾	1,91 %	2,01 %	0,10 %/ -0,07 %
LU0641007009	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽²⁾	EUR/ USD	0,25 %	1,91 %	4,33 %	2,42 %/ -0,07 %
LU0641007264	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged ⁽²⁾	EUR/ GBP	0,25 %	1,91 %	3,42 %	1,51 %/ -0,07 %
LU0641007421	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged ⁽²⁾	EUR/ CHF	0,25 %	1,91 %	-0,08 %	-1,99 %/ -0,07 %
LU0908508814	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	5C	EUR/ EUR	0,20 %	1,91 %	1,83 %	-0,08 %/ -0,07 %
LU0290358224	Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,15 %	5,93 %	5,96 %	0,03 %/ 0,02 %
LU2178481649	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,16 %	5,77 %	5,54 %	-0,23 %/ -0,23 %
LU2504532131	Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	USD/ USD	0,07 %	3,96 %	3,88 %	-0,08 %/ -0,08 %
Stratégies liées aux obligations de sociétés							
LU0478205379	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,12 %	8,19 %	8,03 %	-0,16 %/ -0,15 %
LU0478205965	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,12 %	8,19 %	8,03 %	-0,16 %/ -0,16 %
LU0484968903	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,16 %	8,01 %	7,79 %	-0,22 %/ -0,22 %
LU0484968812	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,16 %	8,01 %	7,78 %	-0,23 %/ -0,23 %
LU1109943388	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,20 %	11,79 %	11,55 %	-0,24 %/ -0,24 %
LU1109942653	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,20 %	11,79 %	11,55 %	-0,24 %/ -0,23 %
LU1109939865	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	EUR/ EUR	0,25 %	8,01 %	7,32 %	-0,69 %/ -0,68 %

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le taux de commission de cette Catégorie d'actions a changé. Veuillez vous reporter à la section relative aux événements significatifs au cours de l'exercice des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽²⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de performance (Performance Difference) est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

« La Différence de suivi (Tracking Difference) est définie comme la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Devise du compartiment/ Devise de la Catégorie d'actions	Commission globale maximale	Performance de l'indice en 2023	Performance de la Catégorie d'actions en 2023	Écart de performance (Performance Difference)/ Différence de suivi (Tracking Difference)
Stratégies liées aux obligations de sociétés (suite)							
LU2673523218	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁵⁾	1D	EUR/ EUR	0,12 %	3,33 %	3,35 %	0,02 %/ 0,02 %
LU2673523309	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁵⁾	1D	EUR/ EUR	0,12 %	4,95 %	4,97 %	0,02 %/ 0,02 %
LU2673523481	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁵⁾	1D	EUR/ EUR	0,12 %	6,04 %	6,01 %	-0,03 %/ -0,03 %
LU2673523564	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁵⁾	1D	EUR/ EUR	0,12 %	7,10 %	7,01 %	-0,09 %/ -0,09 %
Stratégies liées au crédit							
LU0290358653	Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF ⁽⁴⁾	1C	EUR/ EUR	0,18 %	0,93 %	0,79 %	-0,14 %/ -0,13 %
LU0290359032	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF ⁽⁴⁾	1C	EUR/ EUR	0,24 %	3,92 %	3,64 %	-0,28 %/ -0,28 %
LU0321462870	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	EUR/ EUR	0,24 %	-10,68 %	-10,89 %	-0,21 %/ -0,21 %

⁽⁴⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été liquidé. Veuillez vous reporter à la section relative aux événements significatifs au cours de l'exercice des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽⁵⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Les Écarts de performance (Performance Difference) des Catégories d'actions respectives proviennent de nombreux facteurs, tels que la réplication de l'indice par optimisation par rapport à la réplication totale, les divers frais applicables comme la Commission de Société de gestion, les Commissions fixes et les Frais de transaction, les taxes spécifiques, dont l'octroi respectif d'avantages fiscaux, ainsi que des ajustements de swaps positifs ou négatifs comme publiés dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent Rapport annuel.

Écart de suivi réalisé et anticipé

D'après le tableau suivant, pour chacun(e) des Compartiments et/ou des Catégories d'actions lancé(e)s avant le début de l'exercice clos le 31 décembre 2023, les niveaux de l'Écart de suivi réalisé sont restés dans la fourchette prévue, grâce à l'efficacité des techniques de réplification utilisées au cours de l'exercice 2023.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Écart de suivi anticipé	Écart de suivi réalisé en 2023
Stratégies portant sur des liquidités				
LU0290358497	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,00 %
LU0335044896	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,00 %
LU0321465469	Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU0321464652	Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,01 %
Stratégies portant sur les obligations souveraines et sécurisées				
LU0290355717	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0643975591	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2009147591	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2523866023	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0290356871	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0614173549	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0290356954	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU0614173895	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU2606231335	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2C - USD Hedged ^{(1),(2)}	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU2606231418	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2D - GBP Hedged ^{(1),(2)}	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU0290357176	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU0290357259	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2523865728	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1D - GBP Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2523865991	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0290357507	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0290357846	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU0321462953	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 2 %	0,11 %
LU2361257269	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 2 %	0,11 %

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de suivi (Tracking Error) est défini comme la volatilité de la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Écart de suivi anticipé	Écart de suivi réalisé en 2023
Stratégies portant sur les obligations souveraines et sécurisées (suite)				
LU1920015440	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2C	Jusqu'à 2 %	0,11 %
LU0677077884	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	Jusqu'à 2 %	0,11 %
LU0321463258	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU0321463506	Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU0378818131	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0690964092	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0641006290	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0641006456	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3C - USD Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0641006613	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0908508731	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	5C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0378818560	Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU1920015796	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU0429459356	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU2610432036	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2C - GBP Hedged ^{(1),(2)}	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU1399300455	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU1920015523	Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0429458895	Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0643975161	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0468896575	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2523866379	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2523866296	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0468897110	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU0484969463	Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU0524480265	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0962071741	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0494592974	Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,05 %
LU0613540268	Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU0820950128	Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,01 %

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de suivi (Tracking Error) est défini comme la volatilité de la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Écart de suivi anticipé	Écart de suivi réalisé en 2023
Stratégies portant sur les obligations souveraines et sécurisées (suite)				
LU0925589839	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2552296563	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D ⁽²⁾	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU0952581584	Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,01 %
LU0942970103	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,14 %
LU0942970285	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,14 %
LU0942970368	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,14 %
LU0942970442	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,14 %
LU0942970798	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	5C - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,14 %
LU1094612022	Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	Jusqu'à 2 %	0,22 %
LU2462217071	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU2385068163	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU2385068247	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU2385068320	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU2385068593	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU2468423459	Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2504532487	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU2504537445	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,06 %
LU2158769930	Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF ⁽⁴⁾	1D	Jusqu'à 2 %	0,82 %
LU2641054122	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽⁴⁾	1C	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU2641053827	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF ⁽⁴⁾	1C	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU2641054551	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽⁴⁾	1C	Jusqu'à 1 %	0,08 %
LU2662649503	Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF ⁽⁴⁾	1D	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU2662649685	Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF ⁽⁴⁾	1D	Jusqu'à 1 %	0,04 %
LU2662649412	Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF ⁽⁴⁾	1D	Jusqu'à 1 %	0,05 %
Stratégies liées à l'inflation				
LU0290357929	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,31 %

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de suivi (Tracking Error) est défini comme la volatilité de la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽⁴⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Code ISIN	Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Écart de suivi anticipé	Écart de suivi réalisé en 2023
Stratégies liées à l'inflation (suite)				
LU0962078753	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,31 %
LU0641007009	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,31 %
LU0641007264	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,31 %
LU0641007421	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged ⁽¹⁾	Jusqu'à 1 %	0,31 %
LU0908508814	Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	5C	Jusqu'à 1 %	0,31 %
LU0290358224	Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,39 %
LU2178481649	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU2504532131	Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,66 %
Stratégies liées aux obligations de sociétés				
LU0478205379	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU0478205965	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU0484968903	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU0484968812	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,02 %
LU1109943388	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,09 %
LU1109942653	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,09 %
LU1109939865	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	Jusqu'à 1 %	0,03 %
LU2673523218	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁴⁾	1D	Jusqu'à 1 %	0,07 %
LU2673523309	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁴⁾	1D	Jusqu'à 1 %	0,07 %
LU2673523481	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁴⁾	1D	Jusqu'à 1 %	0,14 %
LU2673523564	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁴⁾	1D	Jusqu'à 1 %	0,10 %
Stratégies liées au crédit				
LU0290358653	Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF ⁽³⁾	1C	Jusqu'à 1 %	0,19 %
LU0290359032	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF ⁽³⁾	1C	Jusqu'à 1 %	0,34 %
LU0321462870	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	Jusqu'à 1 %	0,01 %

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions couvertes contre le risque de change :

« L'Écart de suivi (Tracking Error) est défini comme la volatilité de la différence entre le rendement de la Catégorie d'actions non couverte de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽³⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été liquidé. Veuillez vous reporter à la section relative aux événements significatifs au cours de l'exercice des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽⁴⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Xtrackers II

Rapport des Administrateurs (suite)

Luxembourg, le 20 mars 2024

Si, malgré tous nos efforts pour garantir l'exactitude de ce rapport, vous constatez des différences substantielles avec les informations du Prospectus et/ou des Annexes produits, ces dernières prévalent.

Les termes en majuscule utilisés dans le présent document ont la même signification que dans le Prospectus en vigueur, sauf indication contraire imposée par le contexte.

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

Philippe Ah-Sun, Administrateur

Julien Boulliat, Administrateur

KPMG a émis un avis d'audit non qualifié pour l'intégralité du rapport annuel. La traduction du rapport du Réviseur d'entreprises agréé est la suivante :

KPMG Audit S.à r.l.
39, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

Tél. : +352 22 51 51 1
Fax : +352 22 51 71
Mail : info@kpmg.lu
Site Internet : www.kpmg.lu

Aux Actionnaires de Xtrackers II
49, avenue J. F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

RAPPORT DU RÉVISEUR D'ENTREPRISES AGRÉÉ

Rapport sur l'audit des États Financiers

Avis

Nous avons contrôlé les États Financiers de Xtrackers II et de chacun de ses compartiments (« le Fonds »), qui se composent de l'état de l'actif net et de l'état des portefeuilles arrêtés au 31 décembre 2023 et de l'état des opérations et variations de l'actif net pour l'exercice clos à cette date, et les notes aux États Financiers, y compris un résumé des principales politiques comptables.

D'après notre avis, les États Financiers joints donnent une image juste et fidèle de la position financière de Xtrackers II et de chacun de ses Compartiments au 31 décembre 2023, ainsi que des résultats de leurs opérations et des variations de leur actif net pour l'exercice clos à cette date conformément aux exigences juridiques et réglementaires du Luxembourg concernant l'établissement et la présentation des États Financiers.

Fondement de l'avis

Nous avons effectué notre audit conformément à la Réglementation n° 537/2014 de l'UE, à la Loi du 23 juillet 2016 sur la profession d'audit (« Loi du 23 juillet 2016 ») et aux Normes d'audit internationales (« ISA ») adoptées pour le Luxembourg par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (« CSSF »). Nos responsabilités en vertu de cette Réglementation, de cette Loi et de ces Normes adoptées pour le Luxembourg par la CSSF sont décrites plus en détail dans la section « Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé concernant l'audit des États Financiers » de notre rapport. Nous sommes également indépendants du Fonds, conformément au Code international de déontologie à l'usage des comptables professionnels, y compris les Normes internationales d'indépendance, publié par le Conseil des normes internationales de déontologie comptable (« Code de l'IESBA ») adopté pour le Luxembourg par la CSSF avec les exigences déontologiques applicables à notre audit des États Financiers, et nous avons rempli nos autres responsabilités éthiques conformément à ces exigences. Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus sont suffisants et appropriés pour servir de fondement à notre avis.

Principaux éléments de l'audit

Les principaux éléments de l'audit sont ceux qui, selon notre jugement professionnel, ont été les plus significatifs dans l'audit des États Financiers de la période en cours. Ces questions ont été traitées dans le cadre de l'audit des États Financiers dans leur ensemble et en formulant notre avis sur ce sujet, et nous ne donnons pas d'avis distincts sur ces questions.

Évaluation des Swaps de rendement total

Pourquoi cette question a-t-elle été considérée comme l'une des plus importantes lors de l'audit ?

Les Compartiments dotés d'une Politique d'Investissement Indirect (les « Compartiments à Réplication Indirecte ») ne peuvent pas investir directement dans les composants de leur Indice de Référence. Au lieu de cela, l'exposition à la performance de l'Indice de Référence est obtenue grâce à la conclusion de Swaps de rendement total, comme indiqué à la Note 1 b) Objectifs et Politiques d'Investissement des États Financiers.

Dans le cadre de cette Stratégie d'ETF synthétiques, les Compartiments s'appuient sur un mécanisme qui leur permet de participer indirectement à la performance d'un indice. Il s'agit d'un processus impliquant plusieurs étapes et une complexité plus élevée.

Compte tenu de la nature du modèle d'évaluation utilisé, de sa complexité et de son ampleur dans les VL des Compartiments, l'évaluation des Swaps de rendement total est considérée comme le principal moteur de la performance des Compartiments. Elle est donc considérée comme un élément principal de l'audit.

Veillez vous reporter à la Note 2 a) (vii) des États Financiers pour connaître les principes comptables relatifs à la méthode d'évaluation des Swaps de rendement total.

Comment la question a-t-elle été traitée dans notre audit ?

Nos procédures relatives à l'évaluation des Swaps de rendement total comprennent, sans s'y limiter :

- comprendre le processus d'évaluation et de comptabilité mis en place entre la Société de Gestion, le Gestionnaire de Portefeuille et l'Administrateur des Compartiments concernés ;
- Réévaluer les swaps de rendement total par l'intervention de nos propres spécialistes de l'évaluation ;
- convenir de la méthode et des montants des plus-values et moins-values latentes/réalisées liées aux Swaps de rendement total indiqués dans les États Financiers ;
- réaliser des procédures analytiques substantielles pour analyser la corrélation entre les performances de la VL par action des Compartiments à Réplication Indirecte associés et l'indice de suivi.

Autres informations

Le Conseil d'Administration du Fonds est responsable des autres informations. Les autres informations incluent les informations indiquées dans le rapport annuel, mais pas les États Financiers ni notre rapport du Réviseur d'entreprises agréé.

Notre avis sur les États Financiers ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons aucune forme de conclusion avec assurance à ce sujet.

Concernant notre audit des États Financiers, notre responsabilité est de prendre connaissance des autres informations et, ce faisant, de déterminer si les autres informations cadrent avec les informations contenues dans les États Financiers ou les informations collectées dans le cadre de l'audit ou si elles nous semblent substantiellement erronées. Si, au regard des travaux que nous avons réalisés, nous concluons que les autres informations sont substantiellement erronées, nous sommes tenus de signaler cet état de fait. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

Responsabilités du Conseil d'Administration du Fonds concernant les États Financiers

Le Conseil d'Administration du Fonds est responsable de l'établissement et de la présentation fidèle de ces États Financiers conformément aux exigences juridiques et réglementaires luxembourgeoises relatives à l'établissement et à la présentation des États Financiers, ainsi que de tous les contrôles internes qu'il juge nécessaires pour garantir l'établissement et la présentation d'États Financiers exempts d'anomalies significatives, que ce soit à la suite d'une fraude ou d'une erreur.

Dans le cadre de l'établissement des États Financiers, le Conseil d'Administration du Fonds est chargé d'évaluer la capacité du Fonds et de chacun de ses Compartiments à poursuivre leurs activités et à divulguer, si nécessaire, les éléments liés à la poursuite de leurs activités et à utiliser le principe comptable de continuité de l'activité, sauf s'il a l'intention de liquider le Fonds ou l'un de ses Compartiments ou d'en arrêter l'activité, ou qu'il ne peut raisonnablement pas faire autrement.

Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé concernant l'audit des États Financiers

Les objectifs de notre audit sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les États Financiers dans leur ensemble sont exempts d'anomalies significatives, que ce soit à la suite d'une fraude ou d'une erreur, et de publier un rapport du Réviseur d'entreprises agréé qui intègre notre avis. L'assurance raisonnable est un niveau d'assurance élevé qui ne garantit toutefois pas qu'un audit effectué selon la Réglementation n° 537/2014 de l'UE, la Loi du 23 juillet 2016 et les normes d'audit internationales ISA adoptées pour le Luxembourg par la CSSF détecte toujours une éventuelle anomalie. Les anomalies peuvent provenir d'une fraude ou d'une erreur et sont considérées comme significatives dès lors qu'elles sont raisonnablement susceptibles, seules ou collectivement, d'influer sur les décisions économiques que les utilisateurs prennent sur la base des présents États Financiers.

Dans le cadre d'un audit conformément à la Réglementation n° 537/2014 de l'UE, à la Loi du 23 juillet 2016 et aux normes d'audit internationales ISA adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous exerçons un jugement professionnel et faisons preuve d'esprit critique tout au long de l'audit.

Par ailleurs :

- Nous identifions et évaluons les risques d'anomalies des États Financiers, que ce soit à la suite d'une fraude ou d'une erreur, élaborons et appliquons des procédures d'audit en réponse à ces risques, et obtenons des éléments d'audit probants suffisants et appropriés pour servir de fondement à notre avis. Le risque de non-détection est plus élevé pour une anomalie consécutive à une fraude que pour une anomalie consécutive à une erreur, car une fraude peut impliquer une collusion, une falsification, des omissions volontaires, des déformations ou le contournement des contrôles internes.

- Nous accédons à une compréhension des contrôles internes applicables à l'audit afin d'élaborer des procédures d'audit appropriées aux circonstances, mais pas dans le but d'exprimer un avis sur l'efficacité des contrôles internes du Fonds.
- Nous évaluons l'adéquation des principes comptables appliqués et le caractère raisonnable des estimations comptables et des communications associées effectuées par le Conseil d'Administration du Fonds.
- Nous tirons des conclusions sur l'adéquation de l'utilisation par le Conseil d'Administration du Fonds du principe comptable de continuité de l'activité et, sur la base des éléments d'audit probants obtenus, déterminons s'il existe des incertitudes significatives en relation avec des événements et des conditions qui pourraient jeter un doute important sur la capacité du Fonds ou de l'un de ses Compartiments à poursuivre son activité. Si nous concluons à l'existence d'incertitudes significatives, nous sommes tenus d'attirer l'attention dans notre rapport du Réviseur d'entreprises agréé sur les communications correspondantes dans les États Financiers ou, si ces communications sont inappropriées, de modifier notre avis. Nos conclusions reposent sur les éléments d'audit probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport du Réviseur d'entreprises agréé. Toutefois, il se peut que des événements et conditions futurs empêchent le Fonds ou l'un de ses Compartiments de poursuivre son activité.
- Nous évaluons l'ensemble de la présentation, de la structure et du contenu des États Financiers, y compris les communications, et si les États Financiers représentent les transactions et événements sous-jacents de manière à établir une présentation fidèle.

Nous communiquons avec les responsables de la gouvernance concernant, entre autres choses, l'étendue et le calendrier prévus de l'audit et les conclusions importantes de l'audit, y compris toute lacune importante des contrôles internes que nous identifions au cours de notre audit.

Nous fournissons également aux responsables de la gouvernance une déclaration précisant que nous avons respecté les exigences de déontologie applicables en matière d'indépendance, et leur communiquons toutes les relations et autres facteurs qui peuvent raisonnablement être considérés comme susceptibles d'influer sur notre indépendance, et le cas échéant, les mesures prises pour écarter les menaces appliquées.

Parmi les éléments communiqués aux responsables de la gouvernance, nous déterminons quels éléments étaient les plus importants dans l'audit des États Financiers de la période en cours, et sont donc les principaux éléments de l'audit. Nous décrivons ces éléments dans notre rapport à moins que la loi ou la réglementation interdise les communications publiques sur ces éléments.

Rapport sur les autres exigences légales et réglementaires

Nous avons été nommés Réviseur d'entreprises agréé par l'assemblée générale des Actionnaires le 21 avril 2023, et la période d'engagement ininterrompu, y compris les précédents renouvellements et nouvelles nominations, est de trois ans.

Nous confirmons que les services extérieurs à l'audit interdits et indiqués dans la Réglementation n° 537/2014 de l'UE n'ont pas été fournis, et que nous sommes restés indépendants du Fonds au cours de nos travaux d'audit.

Luxembourg, le 20 mars 2024

KPMG Audit S.à r.l.
Cabinet de révision agréé

Valeria Merkel

Xtrackers II

Statistiques

	Code ISIN	Devise	31 décembre 2023		31 décembre 2022		31 décembre 2021	
			VL totale	VL par Action	VL totale	VL par Action	VL totale	VL par Action
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF								
1C	LU0290355717	EUR	2 175 299 270	217,06	1 815 803 777	202,74	2 264 778 500	248,91
1D	LU0643975591	EUR	816 483 423	175,20	377 532 479	166,72	617 419 318	210,16
2C - USD Hedged	LU2009147591	USD	2 966 414	66,08	1 425 202	60,46	2 658 933	72,68
2D - GBP Hedged ⁽¹⁾	LU2523866023	GBP	414 438	6,42	953 857	6,00	-	-
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF								
1C	LU0290356871	EUR	1 538 268 587	164,82	1 250 100 876	159,36	963 832 394	167,20
1D	LU0614173549	EUR	257 504 911	155,13	192 198 794	150,42	196 029 080	158,01
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF								
1C	LU0290356954	EUR	325 628 258	196,96	356 644 018	186,43	509 113 301	207,64
1D	LU0614173895	EUR	18 898 213	183,52	12 965 904	174,56	19 524 987	195,34
2C - USD Hedged ⁽²⁾	LU2606231335	USD	690 889	9,03	-	-	-	-
2D - GBP Hedged ⁽²⁾	LU2606231418	GBP	232 880	8,59	-	-	-	-
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF								
1C	LU0290357176	EUR	600 818 151	225,13	328 512 485	210,21	728 699 146	246,74
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF								
1C	LU0290357259	EUR	536 019 316	245,60	212 092 451	225,18	348 410 923	281,59
1D - GBP Hedged ⁽¹⁾	LU2523865728	GBP	19 702 155	7,59	14 691 894	6,90	-	-
2C - USD Hedged ⁽¹⁾	LU2523865991	USD	405 400 274	8,66	217 625 645	7,77	-	-
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF								
1C	LU0290357507	EUR	51 669 817	288,91	34 998 355	261,48	25 570 205	399,01
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF								
1C	LU0290357846	EUR	125 470 007	285,58	79 695 673	258,54	131 304 694	436,60
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF								
1C - EUR Hedged	LU0290357929	EUR	541 862 068	217,67	694 778 104	213,38	1 270 539 976	263,55
1D - EUR Hedged	LU0962078753	EUR	159 647 745	194,43	170 886 291	191,92	229 503 704	239,10
2C - USD Hedged	LU0641007009	USD	55 923 107	26,49	65 787 888	25,40	91 917 982	30,65
3D - GBP Hedged	LU0641007264	GBP	190 259 666	24,37	209 205 858	23,73	251 686 003	29,28
4D - CHF Hedged	LU0641007421	CHF	41 723 010	94,99	51 496 768	95,75	140 487 496	119,62
5C	LU0908508814	EUR	122 813 800	22,21	144 515 495	21,81	285 441 178	26,24
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF								
1C	LU0290358224	EUR	510 977 254	237,55	656 797 806	224,20	999 857 691	248,52
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF								
1C	LU0290358497	EUR	4 524 260 081	139,53	1 167 539 707	135,11	774 368 875	135,15
1D	LU0335044896	EUR	248 574 547	126,93	7 005 906	126,46	5 603 782	126,50
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF⁽³⁾								
1C	LU0290358653	EUR	-	121,00	8 735 003	120,05	8 189 338	121,17
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF⁽³⁾								
1C	LU0290359032	EUR	-	204,22	61 849 321	197,05	74 477 714	207,25

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, cette Catégorie d'actions a été lancée.

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽³⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été liquidé. Veuillez vous reporter à la section relative aux événements significatifs au cours de l'exercice des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Code ISIN	Devise	31 décembre 2023		31 décembre 2022		31 décembre 2021	
			VL totale	VL par Action	VL totale	VL par Action	VL totale	VL par Action
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF								
1C	LU0321462870	EUR	35 504 972	31,58	72 425 762	35,44	238 792 738	34,73
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF								
1C - EUR Hedged	LU0321462953	EUR	145 822 713	278,76	161 164 913	257,99	278 289 672	327,48
1D - EUR Hedged	LU2361257269	EUR	818 486	10,76	595 917	10,48	1 730 338	13,94
2C	LU1920015440	USD	34 995 278	36,22	5 176 535	32,69	8 941 034	40,22
2D	LU0677077884	USD	158 781 245	11,31	188 872 802	10,79	846 619 441	14,04
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF								
1C	LU0321463258	EUR	16 713 070	79,61	61 820 136	80,71	64 618 682	66,62
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF								
1C	LU0321463506	EUR	25 148 640	181,59	36 727 698	172,45	67 824 819	198,68
1D ⁽⁴⁾	LU0962081203	EUR	-	-	-	-	-	190,73
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF								
1C	LU0321465469	USD	259 301 153	191,28	200 042 429	182,06	316 636 890	179,27
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF								
1D	LU0321464652	GBP	62 064 825	183,51	78 301 602	182,85	65 431 971	181,21
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF								
1C - EUR Hedged	LU0378818131	EUR	723 947 013	208,32	899 756 893	200,63	874 031 721	236,99
1D - EUR Hedged	LU0690964092	EUR	222 200 037	181,68	190 570 497	178,19	239 048 188	216,07
2D - GBP Hedged	LU0641006290	GBP	488 754 925	24,21	374 073 730	23,43	448 993 476	28,01
3C - USD Hedged	LU0641006456	USD	324 068 004	12,68	214 543 365	11,95	140 292 324	13,82
4C - CHF Hedged	LU0641006613	CHF	295 668 902	155,20	153 163 870	152,62	100 110 749	181,21
5C	LU0908508731	EUR	320 295 748	223,18	249 985 312	220,07	319 944 381	254,39
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF								
1C	LU0378818560	SGD	118 855 629	149,04	119 086 202	144,09	152 794 108	152,11
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF								
1C	LU1920015796	USD	151 957 804	7,73	75 290 774	7,42	99 953	8,53
1D	LU0429459356	USD	1 248 062 628	196,23	815 139 640	193,04	738 949 738	226,04
2C - GBP Hedged ⁽²⁾	LU2610432036	GBP	7 309 694	8,82	-	-	-	-
2D - EUR Hedged	LU1399300455	EUR	1 552 367 852	95,74	1 482 493 439	96,14	939 938 688	115,33
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF								
1C	LU1920015523	USD	29 372 456	7,40	1 160 834	7,10	99 987	7,37
1D	LU0429458895	USD	152 439 929	163,20	92 368 309	159,41	79 117 649	167,19
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF								
1C	LU0478205379	EUR	3 856 031 098	150,54	2 153 702 622	139,35	2 815 520 414	161,63
1D	LU0478205965	EUR	9 276 972	7,95	2 280 334	7,49	99 764	8,78
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF								
1C	LU0643975161	EUR	367 576 785	177,20	205 085 306	167,94	135 477 039	204,65
1D	LU0468896575	EUR	447 447 104	174,04	44 342 609	166,90	65 283 395	206,63
2C - USD Hedged ⁽¹⁾	LU2523866379	USD	477 521 287	6,79	1 899 054	6,30	-	-
2D - GBP Hedged ⁽¹⁾	LU2523866296	GBP	25 968 529	5,94	97 834	5,59	-	-
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF								
1D	LU0468897110	EUR	39 946 398	135,79	34 972 872	133,09	15 531 529	141,57

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, cette Catégorie d'actions a été lancée.

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽⁴⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2021, cette Catégorie d'actions a été liquidée. Dernière Valeur liquidative par action avant publication de la liquidation.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Code ISIN	Devise	31 décembre 2023		31 décembre 2022		31 décembre 2021	
			VL totale	VL par Action	VL totale	VL par Action	VL totale	VL par Action
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF								
1C	LU0484968903	EUR	207 436 578	6,62	115 914 868	6,15	1 519 122	7,12
1D	LU0484968812	EUR	2 187 256 110	140,20	1 892 124 336	132,35	1 722 539 412	155,21
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF								
1C	LU0484969463	EUR	11 492 528	200,35	19 786 296	189,66	35 048 191	232,69
1D ⁽⁴⁾	LU0975326215	EUR	-	-	-	-	-	227,06
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF								
1C	LU0524480265	EUR	828 723 002	171,29	721 986 858	158,43	975 825 196	191,96
1D	LU0962071741	EUR	94 427 340	145,77	37 925 256	138,09	188 492 807	173,43
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF								
1C	LU0494592974	AUD	41 921 194	231,20	131 993 898	221,35	104 834 519	253,64
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF								
1C	LU0613540268	EUR	55 048 035	31,96	108 944 927	31,03	77 118 239	31,23
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF								
1C	LU0820950128	EUR	2 283 199	141,00	2 156 236	133,16	5 620 013	161,99
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF								
1C	LU0925589839	EUR	421 128 699	141,86	820 194 051	136,67	548 193 080	143,39
1D ⁽⁵⁾	LU0975334821	EUR	-	-	-	135,72	6 756 316	135,73
2D ⁽²⁾	LU2552296563	EUR	99 114 776	7,10	-	-	-	-
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF								
1C	LU0952581584	JPY	50 972 373 001	1 295,65	53 926 354 234	1 291,40	143 843 531 007	1 397,27
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF								
1D	LU0942970103	USD	245 449 323	40,09	223 977 134	38,77	243 250 296	47,97
2C - USD Hedged	LU0942970285	USD	19 139 428	54,01	21 970 483	50,62	34 509 119	57,86
3D - GBP Hedged	LU0942970368	GBP	3 857 839	69,63	3 044 468	67,11	5 825 899	79,59
4C - CHF Hedged	LU0942970442	CHF	97 106 097	15,58	80 345 044	15,23	110 239 623	17,92
5C - EUR Hedged	LU0942970798	EUR	271 072 699	20,28	213 830 505	19,42	255 563 365	22,73
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF								
1C	LU1109943388	EUR	457 679 841	21,35	334 819 741	19,14	201 558 762	21,18
1D	LU1109942653	EUR	887 290 710	15,80	541 975 244	14,77	896 182 899	16,94
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF								
1D	LU1109939865	EUR	86 956 155	8,62	74 732 655	8,61	123 107 134	9,50
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF								
1D	LU1094612022	USD	30 293 355	21,34	75 133 542	21,65	288 293 086	23,94
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF								
1C	LU2178481649	EUR	1 055 402 873	44,15	834 948 253	41,83	167 842 771	44,99

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽⁴⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2021, cette Catégorie d'actions a été liquidée. Dernière Valeur liquidative par action avant publication de la liquidation.

⁽⁵⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, cette Catégorie d'actions a été liquidée. Dernière Valeur liquidative par action avant publication de la liquidation.

Xtrackers II

Statistiques (suite)

	Code ISIN	Devise	31 décembre 2023		31 décembre 2022		31 décembre 2021	
			VL totale	VL par Action	VL totale	VL par Action	VL totale	VL par Action
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF								
1C ⁽¹⁾	LU2462217071	EUR	20 136 355	8,34	1 470 194	8,10	-	-
1D	LU2385068163	EUR	2 111 164	5,94	12 142 634	5,87	9 825 515	7,13
2D - GBP Hedged	LU2385068247	GBP	12 116 387	6,15	12 109 323	5,93	16 286 007	7,16
3D - USD Hedged	LU2385068320	USD	1 121 400	6,27	1 084 937	6,00	98 674	7,16
4D - EUR Hedged	LU2385068593	EUR	25 245 264	5,99	13 630 060	5,86	98 581	7,16
Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF⁽⁶⁾								
1C	LU2468423459	EUR	77 693 451	27,08	24 381 901	25,51	-	-
Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF⁽⁶⁾								
1C	LU2504532131	USD	4 265 644	34,85	3 032 903	33,55	-	-
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF⁽⁶⁾								
1D	LU2504532487	EUR	6 511 299	35,87	4 322 125	33,23	-	-
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF⁽⁶⁾								
1D	LU2504537445	EUR	108 650 577	42,07	10 143 932	39,86	-	-
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF⁽⁷⁾								
1D	LU2158769930	USD	34 794 632	31,30	-	-	-	-
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF⁽⁷⁾								
1C	LU2641054122	EUR	7 451 290	33,19	-	-	-	-
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF⁽⁷⁾								
1C	LU2641053827	EUR	5 690 160	33,32	-	-	-	-
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF⁽⁷⁾								
1C	LU2641054551	EUR	252 895 673	32,74	-	-	-	-
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF⁽⁷⁾								
1D	LU2673523218	EUR	25 729 108	25,59	-	-	-	-
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF⁽⁷⁾								
1D	LU2673523309	EUR	23 554 982	25,44	-	-	-	-
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF⁽⁷⁾								
1D	LU2673523481	EUR	23 738 222	28,76	-	-	-	-
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF⁽⁷⁾								
1D	LU2673523564	EUR	16 317 855	27,86	-	-	-	-
Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF⁽⁷⁾								
1D	LU2662649503	USD	1 238 858	32,60	-	-	-	-
Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF⁽⁷⁾								
1D	LU2662649685	USD	2 252 641	31,15	-	-	-	-
Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF⁽⁷⁾								
1D	LU2662649412	USD	2 453 603	33,55	-	-	-	-

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, cette Catégorie d'actions a été lancée.

⁽⁶⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, ce Compartiment a été lancé.

⁽⁷⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023

	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
Notes	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché	2 970 411 827	1 788 164 659	343 987 811	609 806 301
Liquidités en banque	861 848	558 644	96 427	159 599
Montant à recevoir du courtier	0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues	339 614	11 137 412	0	0
Produits à recevoir pour investissements vendus	36 627 555	86 722 866	93 385	24 135 598
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant	0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets	28 533 775	8 333 143	1 552 775	2 580 924
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	15 638	0	4 111
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Autres actifs	109 798	86 647	10 397	20 242
TOTAL DE L'ACTIF	3 036 900 055	1 895 003 371	345 744 906	636 702 664
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	0	0	0	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées	339 678	1 241 843	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés	41 057 747	97 537 802	232 362	35 747 817
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
Moins-value latente sur les contrats de change à terme (« futures »)	7	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme	6	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	120 758	28 926	37 268
Commissions fixes	10	427 930	57 710	74 536
Autres engagements	7 588	0	5 249	24 892
TOTAL DES ENGAGEMENTS	41 953 701	99 229 874	324 247	35 884 513
TOTAL DE L'ACTIF NET	2 994 946 354	1 795 773 497	345 420 659	600 818 151

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

	Notes	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
ACTIF					
Investissements à la valeur de marché		919 457 003	51 045 515	124 115 616	1 137 963 659
Liquidités en banque		0	14 611	29 858	5 620 843
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 investissements vendus		32 865 122	161 217	0	3 870 627
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant		28 969	0	0	27 627
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets		5 377 454	622 417	1 351 458	3 238 381
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	2 031 880	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Autres actifs		40 182	444	2 368	81 178
TOTAL DE L'ACTIF		959 800 610	51 844 204	125 499 300	1 150 802 315
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		4 065 382	0	0	68 285
Montant à payer pour parts de fonds rachetées		5 416 863	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés		24 286 911	162 181	0	8 289 310
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
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	2 582 158
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	102 381	4 069	9 507	273 385
Commissions fixes	10	148 917	8 137	19 013	193 452
Autres engagements		29 684	0	773	4 995
TOTAL DES ENGAGEMENTS		34 050 138	174 387	29 293	11 411 585
TOTAL DE L'ACTIF NET		925 750 472	51 669 817	125 470 007	1 139 390 730

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II EUROZONE INFLATION- LINKED BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF
	Notes	EUR	EUR	EUR	USD
ACTIF					
Investissements à la valeur de marché		509 303 402	4 646 459 313	34 605 952	351 751 195
Liquidités en banque		88 041	632 408	9 295	1 758 805
Montant à recevoir du courtier		0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		0	60 957 644	0	0
Produits à recevoir pour investissements vendus		1 064 135	0	0	753 683
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant		0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	127 707 371	0	0
Intérêts à recevoir, nets		1 624 280	36 371 688	363 844	5 963 025
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	90 058 463	543 527	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Autres actifs		33 431	0	0	12 151
TOTAL DE L'ACTIF		512 113 289	4 962 186 887	35 522 618	360 238 859
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	0	0	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés		998 144	127 701 276	0	3 421 322
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		0	0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	60 904 818	1 846	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	869 093
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	45 397	142 305	5 925	94 500
Commissions fixes	10	90 777	569 231	9 875	90 200
Autres engagements		1 717	34 628	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS		1 136 035	189 352 258	17 646	4 475 115
TOTAL DE L'ACTIF NET		510 977 254	4 772 834 629	35 504 972	355 763 744

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

	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
Notes	EUR	EUR	USD	GBP
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché	15 980 917	24 739 607	244 962 187	59 382 771
Liquidités en banque	5 600	0	47 774	11 485
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 investissements vendus	0	0	0	0
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant	0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	176 102	281 763	0	0
Intérêts à recevoir, nets	177 463	73 843	3 543 683	441 210
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4 555 144	341 694	10 801 462	2 241 909
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7 0	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6 0	0	0	0
Autres actifs	0	0	0	0
TOTAL DE L'ACTIF	16 895 226	25 436 907	259 355 106	62 077 375
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	0	316	2 376	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées	0	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés	176 102	281 763	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
Moins-value latente sur les contrats de change à terme (« futures »)	7 0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6 0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10 2 018	2 063	14 380	3 513
Commissions fixes	10 4 036	4 125	37 197	9 037
Autres engagements	0	0	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS	182 156	288 267	53 953	12 550
TOTAL DE L'ACTIF NET	16 713 070	25 148 640	259 301 153	62 064 825

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

	Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF
Notes	EUR	SGD	USD	USD
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché	2 429 998 461	117 931 872	3 110 056 126	180 598 681
Liquidités en banque	40 245 970	44 420	20 803 079	21 317
Montant à recevoir du courtier	0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues	0	0	5 323 418	0
Produits à recevoir pour investissements vendus	30 818 022	0	50 625 245	0
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant	196 508	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets	17 437 347	918 112	22 969 014	1 204 092
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Autres actifs	54 445	0	294 861	6 709
TOTAL DE L'ACTIF	2 518 750 753	118 894 404	3 210 071 743	181 830 799
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	2 010 409	0	343 954	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées	0	0	14 654 084	0
Montant à payer pour les investissements achetés	70 440 348	0	61 106 989	0
Montant à payer sur les contrats de change au comptant	0	0	28 431	0
Montant à payer sur les conventions de swap	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	3 588 952	9 273 931	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	518 450	19 387	57 632
Commissions fixes	10	328 455	19 388	444 538
Autres engagements	0	0	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS	76 886 614	38 775	85 909 559	18 414
TOTAL DE L'ACTIF NET	2 441 864 139	118 855 629	3 124 162 184	181 812 385

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF
Notes	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché	3 819 641 564	1 263 680 930	39 769 572	2 365 739 668
Liquidités en banque	5 245 164	845	12 835	1 106 920
Montant à recevoir du courtier	7 422	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues	0	0	0	0
Produits à recevoir pour investissements vendus	22 261 324	14 490 294	2 053 156	19 758 307
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant	0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets	44 907 820	11 384 331	220 589	27 414 858
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	2 393 505	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	24 080
Autres actifs	84 505	90 375	2 044	0
TOTAL DE L'ACTIF	3 892 147 799	1 292 040 280	42 058 196	2 414 043 833
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	0	4 385 402	0	13 162
Montant à payer pour parts de fonds rachetées	0	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés	26 091 486	10 010 028	2 101 871	18 698 898
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
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	1 653	0	0
Commission de Société de gestion	10	124 446	146 774	3 309
Commissions fixes	10	622 145	222 890	6 618
Autres engagements	0	0	0	7 884
TOTAL DES ENGAGEMENTS	26 839 730	14 765 094	2 111 798	19 351 145
TOTAL DE L'ACTIF NET	3 865 308 069	1 277 275 186	39 946 398	2 394 692 688

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF
	Notes	EUR	EUR	AUD	EUR
ACTIF					
Investissements à la valeur de marché		11 024 501	913 702 005	41 788 051	53 800 484
Liquidités en banque		2 844	414 257	107 855	14 585
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 investissements vendus		0	62 169 579	23 547	0
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant		0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets		144 500	8 375 626	154 819	299 558
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	323 714	0	0	950 954
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Autres actifs		0	24 938	342	0
TOTAL DE L'ACTIF		11 495 559	984 686 405	42 074 614	55 065 581
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	0	0	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés		0	61 340 892	118 433	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	4 414
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	1 010	65 040	20 992	4 377
Commissions fixes	10	2 021	130 087	13 995	8 755
Autres engagements		0	44	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS		3 031	61 536 063	153 420	17 546
TOTAL DE L'ACTIF NET		11 492 528	923 150 342	41 921 194	55 048 035

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	
	Notes	EUR	EUR	JPY	USD
ACTIF					
Investissements à la valeur de marché		2 205 665	517 002 503	50 872 105 719	678 183 287
Liquidités en banque		280	0	109 316 358	6 939 123
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 investissements vendus		0	57 176 756	1 061 321 721	4 575 135
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant		0	0	0	16 718
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets		20 265	3 843 268	101 198 972	4 729 529
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	57 735	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Autres actifs		0	23 539	0	4 518
TOTAL DE L'ACTIF		2 283 945	578 046 066	52 143 942 770	694 448 310
ENGAGEMENTS					
Découvert bancaire		0	6 006 368	0	7 889
Montant à payer pour parts de fonds rachetées		0	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés		0	51 638 596	1 158 995 417	9 054 814
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
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0	862 996
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	373	64 740	4 183 965	55 423
Commissions fixes	10	373	89 192	8 367 926	128 005
Autres engagements		0	3 696	22 461	16 101
TOTAL DES ENGAGEMENTS		746	57 802 592	1 171 569 769	10 125 228
TOTAL DE L'ACTIF NET		2 283 199	520 243 474	50 972 373 001	684 323 082

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF
Notes	EUR	EUR	USD	EUR
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché	1 338 389 537	84 553 312	29 676 016	1 046 072 475
Liquidités en banque	406 594	18 910	4 484 858	332 177
Montant à recevoir du courtier	0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues	6 234 570	0	0	0
Produits à recevoir pour investissements vendus	27 100 888	0	0	18 493 333
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant	0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets	17 577 862	1 107 378	423 424	10 404 949
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	0	1 311 754	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	0	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	0	0	0	0
Autres actifs	103 835	0	0	5 830
TOTAL DE L'ACTIF	1 389 813 286	86 991 354	34 584 298	1 075 308 764
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	0	0	0	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées	6 234 093	0	4 258 080	0
Montant à payer pour les investissements achetés	38 198 569	0	0	19 648 672
Montant à payer sur les contrats de change au comptant	0	0	11 453	0
Montant à payer sur les conventions de swap	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	0	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	0	0	0	0
Commission de Société de gestion	205 036	21 119	3 939	96 457
Commissions fixes	205 037	14 080	9 271	160 762
Autres engagements	0	0	8 200	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS	44 842 735	35 199	4 290 943	19 905 891
TOTAL DE L'ACTIF NET	1 344 970 551	86 956 155	30 293 355	1 055 402 873

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II TIPS US INFLATION- LINKED BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF
Notes	EUR	EUR	USD	EUR
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché	62 036 460	76 958 974	4 250 537	6 463 482
Liquidités en banque	120 063	29 630	874	4 048
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 investissements vendus	689 158	451 427	50 929	0
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant	1 180	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets	474 522	735 495	14 672	47 219
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Autres actifs	311	275	22	117
TOTAL DE L'ACTIF	63 321 694	78 175 801	4 317 034	6 514 866
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	44 567	0	0	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées	0	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés	683 023	463 440	50 965	1 779
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
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	79 688	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	13 572	61	795
Commissions fixes	10	10 220	364	993
Autres engagements	0	0	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS	831 070	482 350	51 390	3 567
TOTAL DE L'ACTIF NET	62 490 624	77 693 451	4 265 644	6 511 299

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF
Notes	EUR	USD	EUR	EUR
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché	107 687 912	34 063 501	7 589 003	5 653 657
Liquidités en banque	20 408	566 408	1 771	2 381
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 investissements vendus	694 992	634 260	366 892	439 422
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant	0	925	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets	1 025 979	575 774	52 953	35 745
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Autres actifs	408	173	40	0
TOTAL DE L'ACTIF	109 429 699	35 841 041	8 010 659	6 131 205
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	0	329 719	0	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées	0	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés	758 377	702 991	558 549	440 222
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
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	3 458	2 740	117
Commissions fixes	10	17 287	10 959	705
Autres engagements	0	0	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS	779 122	1 046 409	559 369	441 045
TOTAL DE L'ACTIF NET	108 650 577	34 794 632	7 451 290	5 690 160

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF
	Notes	EUR	EUR	EUR
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché		263 557 346	25 389 832	23 067 890
Liquidités en banque		10 472 040	82 430	274 528
Montant à recevoir du courtier		0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		0	0	0
Produits à recevoir pour investissements vendus		0	472 645	372 267
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant		0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap		0	0	0
Intérêts à recevoir, nets		1 932 002	275 173	247 178
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Autres actifs		0	17	26
TOTAL DE L'ACTIF		275 961 388	26 220 097	23 961 889
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire		0	0	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées		0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés		23 060 743	486 928	403 663
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		0	0	0
Montant à payer sur les conventions de swap		0	0	0
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	710	677	541
Commissions fixes	10	4 262	3 384	2 703
Autres engagements		0	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS		23 065 715	490 989	406 907
TOTAL DE L'ACTIF NET		252 895 673	25 729 108	23 554 982

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF	Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF	Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF
Notes	EUR	USD	USD	USD
ACTIF				
Investissements à la valeur de marché	16 018 823	1 229 298	2 236 344	2 431 137
Liquidités en banque	1 029	936	393	636
Montant à recevoir du courtier	0	0	0	0
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues	0	0	0	673 768
Produits à recevoir pour investissements vendus	503 799	0	0	0
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant	0	0	0	0
Produits à recevoir sur les conventions de swap	0	0	0	0
Intérêts à recevoir, nets	300 097	8 675	15 963	21 518
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Autres actifs	48	0	5	780
TOTAL DE L'ACTIF	16 823 796	1 238 909	2 252 705	3 127 839
ENGAGEMENTS				
Découvert bancaire	0	0	0	0
Montant à payer pour parts de fonds rachetées	0	0	0	0
Montant à payer pour les investissements achetés	504 045	0	0	674 165
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
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	0	0	0
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	316	9	11
Commissions fixes	10	1 580	42	53
Autres engagements	0	0	0	0
TOTAL DES ENGAGEMENTS	505 941	51	64	674 236
TOTAL DE L'ACTIF NET	16 317 855	1 238 858	2 252 641	2 453 603

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État de l'actif net au 31 décembre 2023 (suite)

		COMBINÉ
	Notes	EUR
ACTIF		
Investissements à la valeur de marché		32 381 327 795
Liquidités en banque		99 074 746
Montant à recevoir du courtier		7 422
Produits à recevoir pour parts de fonds vendues		84 098 277
Produits à recevoir pour investissements vendus		502 651 142
Produits à recevoir sur les contrats de change au comptant		270 256
Produits à recevoir sur les conventions de swap		128 165 236
Intérêts à recevoir, nets		276 373 441
Montant net de la contrepartie de swap et résultat latent sur swap	4	106 508 390
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	7	4 445 134
Plus-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	24 080
Autres actifs		1 064 653
TOTAL DE L'ACTIF		33 584 010 572
ENGAGEMENTS		
Découvert bancaire		17 213 035
Montant à payer pour parts de fonds rachetées		30 352 978
Montant à payer pour les investissements achetés		738 140 100
Montant à payer sur les contrats de change au comptant		36 106
Montant à payer sur les conventions de swap		60 911 078
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	7	16 214 152
Moins-value latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)	6	1 653
Commission de Société de gestion	10	2 705 788
Commissions fixes	10	4 902 285
Autres engagements		143 293
TOTAL DES ENGAGEMENTS		870 620 468
TOTAL DE L'ACTIF NET		32 713 390 104

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023

		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
	Notes	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		2 195 746 748	1 442 299 670	369 609 922	328 512 485
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		52 245 477	12 577 182	2 754 182	4 233 437
Accroissement de l'écart d'actualisation		1 002 746	28 839 671	4 977 568	5 812 077
Revenus issus du prêt de titres, nets		1 434 750	1 101 766	228 438	257 837
TOTAL DES REVENUS		54 682 973	42 518 619	7 960 188	10 303 351
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	967 120	856 613	161 490	192 891
Commissions fixes	10	2 418 539	1 713 226	322 661	385 782
TOTAL DES DÉPENSES		3 385 659	2 569 839	484 151	578 673
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		51 297 314	39 948 780	7 476 037	9 724 678
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(122 071 527)	(42 774 334)	(13 634 035)	(23 850 488)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(18 985)	0	(19 022)	180
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		28 886	0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(122 061 626)	(42 774 334)	(13 653 057)	(23 850 308)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		263 364 324	55 726 861	26 634 358	42 152 614
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		27 616	0	4 111	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS- VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		263 391 940	55 726 861	26 638 469	42 152 614
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		192 627 628	52 901 307	20 461 449	28 026 984
Dividendes distribués	15	(9 402 615)	(710 061)	(67 634)	0
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		2 207 618 742	2 213 300 308	217 138 703	795 609 036
Rachat d'actions		(1 591 644 149)	(1 912 017 727)	(261 721 781)	(551 330 354)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		2 994 946 354	1 795 773 497	345 420 659	600 818 151

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (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
	Notes	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		432 564 350	34 998 355	79 695 673	1 359 771 849
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		7 649 168	1 233 033	2 357 487	57 191 496
Accroissement de l'écart d'actualisation		10 990 886	63 103	801 356	0
Revenus issus du prêt de titres, nets		400 063	3 156	37 389	1 076 533
TOTAL DES REVENUS		19 040 117	1 299 292	3 196 232	58 268 029
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		0	0	0	15 107 258
Commission de Société de gestion	10	450 857	21 065	48 479	1 798 377
Commissions fixes	10	625 186	42 130	96 958	1 246 978
TOTAL DES DÉPENSES		1 076 043	63 195	145 437	18 152 613
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		17 964 074	1 236 097	3 050 795	40 115 416
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins- value) nette latente sur swap	4	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(11 925 258)	(1 696 006)	(18 180 326)	(82 266 481)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(8 209 924)	0	0	26 986 197
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(20 135 182)	(1 696 006)	(18 180 326)	(55 280 284)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		65 203 741	5 387 401	26 490 227	51 167 594
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		3 119 293	0	0	(5 092 402)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS- VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		68 323 034	5 387 401	26 490 227	46 075 192
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		66 151 926	4 927 492	11 360 696	30 910 324
Dividendes distribués	15	(66 320)	0	0	(3 017 771)
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		973 892 921	18 902 205	70 947 719	225 813 814
Rachat d'actions		(546 792 405)	(7 158 235)	(36 534 081)	(474 087 486)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		925 750 472	51 669 817	125 470 007	1 139 390 730

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (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
	Notes	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		656 797 806	1 174 545 612	8 735 003	61 849 321
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		22 272 442	47 047 557	38 083	208 165
Accroissement de l'écart d'actualisation		0	49 231 780	30 073	385 542
Revenus issus du prêt de titres, nets		553 890	0	0	0
TOTAL DES REVENUS		22 826 332	96 279 337	68 156	593 707
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		8 687 419	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	294 603	440 063	1 424	15 651
Commissions fixes	10	589 206	1 760 254	1 779	26 084
TOTAL DES DÉPENSES		9 571 228	2 200 317	3 203	41 735
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		13 255 104	94 079 020	64 953	551 972
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	(242 438 627)	12 281	1 943 694
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(47 756 696)	115 839 667	(237 482)	(1 718 164)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		0	(27 600 923)	23	(4 325)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(47 756 696)	88 238 744	(237 459)	(1 722 489)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		66 411 077	138 040 646	227 127	1 401 548
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	0	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS- VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		66 411 077	138 040 646	227 127	1 401 548
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		31 909 485	77 919 783	66 902	2 174 725
Dividendes distribués	15	0	(1 853 334)	0	0
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		235 231 937	5 373 172 293	0	8 911 544
Rachat d'actions		(412 961 974)	(1 850 949 725)	(8 801 905)	(72 935 590)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		510 977 254	4 772 834 629	0	0

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (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
	Notes	EUR	USD	EUR	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		72 425 762	366 688 506	61 820 136	36 727 698
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		1 045 811	20 041 859	1 089 545	1 174 907
Accroissement de l'écart d'actualisation		1 362 192	1 974 442	572 253	372 903
Revenus issus du prêt de titres, nets		0	191 221	0	0
TOTAL DES REVENUS		2 408 003	22 207 522	1 661 798	1 547 810
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	53 627	606 870	19 616	16 536
Commissions fixes	10	89 379	529 775	39 233	33 072
TOTAL DES DÉPENSES		143 006	1 136 645	58 849	49 608
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		2 264 997	21 070 877	1 602 949	1 498 202
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	(6 843 303)	0	(1 179 350)	1 742 657
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(4 166 627)	(23 422 044)	(6 392 944)	(4 949 229)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		664	3 640 548	(851 596)	(129 645)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(4 165 963)	(19 781 496)	(7 244 540)	(5 078 874)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		2 505 458	38 816 097	6 562 428	3 316 947
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	(1 709 359)	0	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS- VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		2 505 458	37 106 738	6 562 428	3 316 947
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		(6 238 811)	38 396 119	(258 513)	1 478 932
Dividendes distribués	15	0	(9 609 689)	0	0
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		30 472 856	113 074 904	23 500 498	2 005 030
Rachat d'actions		(61 154 835)	(152 786 096)	(68 349 051)	(15 063 020)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		35 504 972	355 763 744	16 713 070	25 148 640

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (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
	Notes	USD	GBP	EUR	SGD
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		200 042 429	78 301 602	2 118 072 321	119 086 202
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		5 006 539	1 322 305	41 934 822	2 982 969
Accroissement de l'écart d'actualisation		5 253 557	1 000 926	1 154 980	0
Revenus issus du prêt de titres, nets		0	0	573 460	0
TOTAL DES REVENUS		10 260 096	2 323 231	43 663 262	2 982 969
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		0	0	0	384 327
Commission de Société de gestion	10	104 863	30 451	2 831 201	117 930
Commissions fixes	10	218 163	62 912	1 974 478	117 931
TOTAL DES DÉPENSES		323 026	93 363	4 805 679	620 188
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		9 937 070	2 229 868	38 857 583	2 362 781
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	(10 379 367)	4 028 142	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(8 147 144)	(7 537 118)	(83 107 165)	(1 051 916)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		12 841 095	(749 096)	50 130 665	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	1 696	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		4 693 951	(8 286 214)	(32 974 804)	(1 051 916)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		6 820 004	4 842 621	97 809 458	2 715 232
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	(1 276 452)	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS- VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		6 820 004	4 842 621	96 533 006	2 715 232
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		11 071 658	2 814 417	102 415 785	4 026 097
Dividendes distribués	15	0	(2 698 077)	(11 847 131)	0
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		275 635 135	34 085 363	1 366 886 332	0
Rachat d'actions		(227 448 069)	(50 438 480)	(1 133 663 168)	(4 256 670)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		259 301 153	62 064 825	2 441 864 139	118 855 629

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF
	Notes	USD	USD	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		2 472 620 836	93 529 142	2 155 982 956
REVENUS				
Dividendes nets		0	0	5
Intérêts sur obligations, nets		76 318 945	2 917 480	66 755 484
Accroissement de l'écart d'actualisation		26 133 484	2 369 190	33 661 670
Revenus issus du prêt de titres, nets		2 422 762	0	1 061 049
TOTAL DES REVENUS		104 875 191	5 286 670	101 478 208
DÉPENSES				
Amortissement de la prime		0	0	0
Commission de Société de gestion	10	300 567	12 945	636 066
Commissions fixes	10	2 323 394	76 170	3 180 331
TOTAL DES DÉPENSES		2 623 961	89 115	3 816 397
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		102 251 230	5 197 555	97 661 811
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(119 839 505)	(1 650 184)	(93 155 625)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		42 769 150	46	14
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	(35 872)
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(77 070 355)	(1 650 138)	(93 191 483)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		124 646 237	2 567 474	250 259 683
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		(16 999 174)	0	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	(10 673)
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		107 647 063	2 567 474	250 249 010
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		132 827 938	6 114 891	254 719 338
Dividendes distribués	15	(67 396 604)	(2 370 121)	(91 733)
ÉVOLUTION DU CAPITAL				
Souscriptions d'actions		2 921 444 019	145 915 702	3 128 281 030
Rachat d'actions		(2 335 334 005)	(61 377 229)	(1 673 583 522)
Ajustement monétaire		0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		3 124 162 184	181 812 385	3 865 308 069

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF
	Notes	EUR	EUR	EUR	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		34 972 872	2 008 039 204	19 786 296	759 912 113
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		269 354	48 900 585	171 766	21 035 320
Accroissement de l'écart d'actualisation		453 044	21 777 132	118 878	0
Revenus issus du prêt de titres, nets		15 084	0	0	169 805
TOTAL DES REVENUS		737 482	70 677 717	290 644	21 205 125
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		0	0	0	3 424 163
Commission de Société de gestion	10	17 411	1 434 669	7 886	403 833
Commissions fixes	10	34 821	2 391 115	15 771	807 667
TOTAL DES DÉPENSES		52 232	3 825 784	23 657	4 635 663
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		685 250	66 851 933	266 987	16 569 462
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	0	605 321	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(685 323)	(59 930 632)	(2 376 214)	(32 875 160)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		0	(23)	66 321	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		932	70 883	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(684 391)	(59 859 772)	(2 309 893)	(32 875 160)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		1 038 421	165 499 693	2 189 893	81 742 650
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	0	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		(960)	(28 263)	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		1 037 461	165 471 430	2 189 893	81 742 650
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		1 038 320	172 463 591	752 308	65 436 952
Dividendes distribués	15	(194 501)	(38 845 495)	0	(815 728)
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		16 673 686	1 092 636 243	14 796 511	340 571 070
Rachat d'actions		(12 543 979)	(839 600 855)	(23 842 587)	(241 954 065)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		39 946 398	2 394 692 688	11 492 528	923 150 342

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (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
	Notes	AUD	EUR	EUR	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		131 993 898	108 944 927	2 156 236	820 194 051
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		2 554 986	2 054 443	36 089	16 793 517
Accroissement de l'écart d'actualisation		399 329	1 286 132	48 160	2 021 655
Revenus issus du prêt de titres, nets		2 790	0	0	281 173
TOTAL DES REVENUS		2 957 105	3 340 575	84 249	19 096 345
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	147 685	36 034	2 193	396 580
Commissions fixes	10	98 457	72 067	2 193	793 159
TOTAL DES DÉPENSES		246 142	108 101	4 386	1 189 739
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		2 710 963	3 232 474	79 863	17 906 606
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	893 930	38 065	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(14 994 865)	(8 256 706)	(544 681)	(17 275 066)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(104)	(4 211 864)	44 104	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(14 994 969)	(12 468 570)	(500 577)	(17 275 066)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		14 864 913	10 253 585	509 612	23 754 411
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	0	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		14 864 913	10 253 585	509 612	23 754 411
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		2 580 907	1 911 419	126 963	24 385 951
Dividendes distribués	15	0	0	0	(1 704 602)
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		106 806 950	26 338 472	0	439 998 830
Rachat d'actions		(199 460 561)	(82 146 783)	0	(762 630 756)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		41 921 194	55 048 035	2 283 199	520 243 474

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF
	Notes	JPY	USD	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		53 926 354 234	564 661 045	876 794 985
REVENUS				
Dividendes nets		0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		507 632 614	16 116 798	47 769 747
Accroissement de l'écart d'actualisation		0	2 154 013	19 006 286
Revenus issus du prêt de titres, nets		0	0	1 377 875
TOTAL DES REVENUS		507 632 614	18 270 811	68 153 908
DÉPENSES				
Amortissement de la prime		307 667 118	0	0
Commission de Société de gestion	10	25 078 450	268 208	1 087 266
Commissions fixes	10	50 156 900	601 751	1 087 267
TOTAL DES DÉPENSES		382 902 468	869 959	2 174 533
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		124 730 146	17 400 852	65 979 375
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(1 249 378 682)	(11 114 291)	(26 641 564)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(65 168)	9 297 950	(4)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		1 561 183	6 429	45 918
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(1 247 882 667)	(1 809 912)	(26 595 650)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		1 262 133 363	30 288 298	82 275 279
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	(921 238)	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	(5 496)	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		1 262 133 363	29 361 564	82 275 279
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		138 980 842	44 952 504	121 659 004
Dividendes distribués	15	0	(5 232 521)	(28 852 285)
ÉVOLUTION DU CAPITAL				
Souscriptions d'actions		12 331 806 190	427 174 530	1 440 817 870
Rachat d'actions		(15 424 768 265)	(347 232 476)	(1 065 449 023)
Ajustement monétaire		0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		50 972 373 001	684 323 082	1 344 970 551

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

	Notes	USD	EUR	EUR	EUR
		Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		75 133 542	834 948 253	41 907 920	24 381 901
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		1 402 987	16 088 803	986 700	1 298 794
Accroissement de l'écart d'actualisation		0	3 306 863	343 761	848 542
Revenus issus du prêt de titres, nets		0	0	0	0
TOTAL DES REVENUS		1 402 987	19 395 666	1 330 461	2 147 336
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		58 038	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	24 861	552 700	67 574	40 981
Commissions fixes	10	74 583	921 167	48 413	81 963
TOTAL DES DÉPENSES		157 482	1 473 867	115 987	122 944
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		1 245 505	17 921 799	1 214 474	2 024 392
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		870 515	(3 813 642)	(1 440 810)	(2 330 296)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(4 653 713)	0	152 278	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(3 783 198)	(3 813 642)	(1 288 532)	(2 330 296)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		3 232 143	35 551 754	2 789 832	3 080 011
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	(54 611)	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		3 232 143	35 551 754	2 735 221	3 080 011
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		694 450	49 659 911	2 661 163	2 774 107
Dividendes distribués	15	(1 726 481)	0	(768 776)	0
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		1 079 284	396 555 288	58 742 117	120 093 478
Rachat d'actions		(44 887 440)	(225 760 579)	(40 051 800)	(69 556 035)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		30 293 355	1 055 402 873	62 490 624	77 693 451

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

	Notes	Xtrackers II TIPS US INFLATION- LINKED BOND UCITS ETF USD	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF EUR	Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF EUR	Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF USD
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		3 032 903	4 322 125	10 143 932	0
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		195 577	86 131	2 002 692	1 672 307
Accroissement de l'écart d'actualisation		45 566	75 511	1 051 197	556 079
Revenus issus du prêt de titres, nets		0	0	0	0
TOTAL DES REVENUS		241 143	161 642	3 053 889	2 228 386
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	435	4 079	21 173	15 872
Commissions fixes	10	2 613	5 098	105 863	63 488
TOTAL DES DÉPENSES		3 048	9 177	127 036	79 360
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		238 095	152 465	2 926 853	2 149 026
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		(193 657)	(217 470)	(1 198 269)	(378 421)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		0	0	0	(1 216 275)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		(193 657)	(217 470)	(1 198 269)	(1 594 696)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		(13 746)	548 986	2 406 757	738 070
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	0	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		(13 746)	548 986	2 406 757	738 070
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		30 692	483 981	4 135 341	1 292 400
Dividendes distribués	15	0	(65 995)	(1 147 880)	0
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		11 818 835	4 124 329	184 567 927	60 291 150
Rachat d'actions		(10 616 786)	(2 353 141)	(89 048 743)	(26 788 918)
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		4 265 644	6 511 299	108 650 577	34 794 632

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF	Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF
	Notes	EUR	EUR	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		0	0	0
REVENUS				
Dividendes nets		0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		29 228	28 028	65 700
Accroissement de l'écart d'actualisation		39 996	34 452	150 239
Revenus issus du prêt de titres, nets		0	0	0
TOTAL DES REVENUS		69 224	62 480	215 939
DÉPENSES				
Amortissement de la prime		0	0	0
Commission de Société de gestion	10	193	170	724
Commissions fixes	10	1 161	1 023	4 342
TOTAL DES DÉPENSES		1 354	1 193	5 066
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		67 870	61 287	210 873
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		3 524	6 079	81 798
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		3 524	6 079	81 798
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		3 181	2 739	(43 857)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		3 181	2 739	(43 857)
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		74 575	70 105	248 814
Dividendes distribués	15	0	0	0
ÉVOLUTION DU CAPITAL				
Souscriptions d'actions		7 376 715	8 948 545	255 682 909
Rachat d'actions		0	(3 328 490)	(3 036 050)
Ajustement monétaire		0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		7 451 290	5 690 160	252 895 673

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

		Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF
	Notes	EUR	EUR	EUR	USD
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		0	0	0	0
REVENUS					
Dividendes nets		0	0	0	0
Intérêts sur obligations, nets		56 547	58 078	48 436	2 061
Accroissement de l'écart d'actualisation		52 732	38 712	15 818	1 391
Revenus issus du prêt de titres, nets		0	0	0	0
TOTAL DES REVENUS		109 279	96 790	64 254	3 452
DÉPENSES					
Amortissement de la prime		0	0	0	0
Commission de Société de gestion	10	541	481	316	9
Commissions fixes	10	2 703	2 402	1 580	42
TOTAL DES DÉPENSES		3 244	2 883	1 896	51
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		106 035	93 907	62 358	3 401
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins- value) nette latente sur swap	4	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		25 674	192 629	55 052	244
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		25 674	192 629	55 052	244
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		779 390	652 548	623 821	15 888
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	0	0
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	0	0
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS- VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		779 390	652 548	623 821	15 888
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		911 099	939 084	741 231	19 533
Dividendes distribués	15	0	0	0	0
ÉVOLUTION DU CAPITAL					
Souscriptions d'actions		22 643 883	27 283 102	15 576 624	1 219 325
Rachat d'actions		0	(4 483 964)	0	0
Ajustement monétaire		0	0	0	0
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		23 554 982	23 738 222	16 317 855	1 238 858

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des opérations et Variations de l'actif net
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

	Notes	Xtrackers II	Xtrackers II	COMBINÉ
		US TREASURIES 7-10 UCITS ETF	US TREASURIES 10+ UCITS ETF	
		USD	USD	EUR
ACTIF NET AU DÉBUT DE L'EXERCICE		0	0	22 638 756 371
REVENUS				
Dividendes nets		0	0	5
Intérêts sur obligations, nets		2 925	3 944	612 050 024
Accroissement de l'écart d'actualisation		1 440	1 452	233 720 800
Revenus issus du prêt de titres, nets		0	0	11 300 294
TOTAL DES REVENUS		4 365	5 396	857 071 123
DÉPENSES				
Amortissement de la prime		0	0	29 510 664
Commission de Société de gestion	10	11	12	15 025 877
Commissions fixes	10	53	59	25 790 827
TOTAL DES DÉPENSES		64	71	70 327 368
REVENU NET/(PERTE NETTE) RÉSULTANT DES INVESTISSEMENTS		4 301	5 325	786 743 755
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap	4	0	0	(245 875 129)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements		465	1 325	(795 450 408)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		0	0	89 825 386
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	142 712
PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE RÉALISÉE HORS SWAP		465	1 325	(705 482 310)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les investissements		27 267	57 997	1 797 184 450
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats de change à terme		0	0	(18 639 655)
Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur les contrats à terme ferme (« futures »)		0	0	(59 371)
VARIATION DE LA PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE HORS SWAP		27 267	57 997	1 778 485 424
AUGMENTATION/(DIMINUTION) NETTE DE L'ACTIF NET RÉSULTANT DES OPÉRATIONS		32 033	64 647	1 613 871 740
Dividendes distribués	15	0	0	(189 340 458)
ÉVOLUTION DU CAPITAL				
Souscriptions d'actions		2 220 608	2 388 956	27 035 807 383
Rachat d'actions		0	0	(18 227 555 002)
Ajustement monétaire		0	0	(158 149 930)
ACTIF NET À LA FIN DE L'EXERCICE		2 252 641	2 453 603	32 713 390 104

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des variations des Actions émises
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023

Compartiment	Code ISIN	Catégorie d'actions	Nombre d'actions au 31 décembre 2022	Nombre d'actions émises	Nombre d'actions rachetées	Nombre d'actions au 31 décembre 2023
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0290355717	1C	8 956 314	7 200 103	(6 134 905)	10 021 512
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0643975591	1D	2 264 470	4 269 539	(1 873 663)	4 660 346
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2009147591	2C - USD Hedged	23 573	60 004	(38 684)	44 893
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2523866023	2D - GBP Hedged	158 995	407 452	(501 926)	64 521
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	LU0290356871	1C	7 844 755	12 875 630	(11 387 283)	9 333 102
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	LU0614173549	1D	1 277 789	896 223	(514 080)	1 659 932
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	LU0290356954	1C	1 913 030	1 091 018	(1 350 756)	1 653 292
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	LU0614173895	1D	74 278	50 191	(21 491)	102 978
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	LU2606231335	2C - USD Hedged	0	76 499	0	76 499
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	LU2606231418	2D - GBP Hedged	0	27 096	0	27 096
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	LU0290357176	1C	1 562 809	3 655 500	(2 549 500)	2 668 809
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	LU0290357259	1C	941 862	3 342 456	(2 101 809)	2 182 509
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	LU2523865728	1D - GBP Hedged	2 130 415	1 075 894	(611 439)	2 594 870
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	LU2523865991	2C - USD Hedged	27 996 050	25 072 714	(6 255 000)	46 813 764
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	LU0290357507	1C	133 846	72 000	(27 000)	178 846
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	LU0290357846	1C	308 247	270 600	(139 500)	439 347
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	LU0290357929	1C - EUR Hedged	3 256 049	611 087	(1 377 779)	2 489 357
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	LU0962078753	1D - EUR Hedged	890 418	9 627	(78 924)	821 121
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	LU0641007009	2C - USD Hedged	2 590 467	267 053	(746 794)	2 110 726
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	LU0641007264	3D - GBP Hedged	8 816 410	1 205 635	(2 215 148)	7 806 897
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	LU0641007421	4D - CHF Hedged	537 848	68 690	(167 322)	439 216
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	LU0908508814	5C	6 626 480	2 167 827	(3 264 371)	5 529 936
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	LU0290358224	1C	2 929 498	1 016 500	(1 795 000)	2 150 998
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	LU0290358497	1C	8 641 663	37 301 241	(13 517 767)	32 425 137
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	LU0335044896	1D	55 401	1 913 033	(10 000)	1 958 434
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	LU0290358653	1C	72 762	0	(72 762)	0
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	LU0290359032	1C	313 877	44 547	(358 424)	0

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des variations des Actions émises
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

Compartiment	Code ISIN	Catégorie d'actions	Nombre d'actions au 31 décembre 2022	Nombre d'actions émises	Nombre d'actions rachetées	Nombre d'actions au 31 décembre 2023
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	LU0321462870	1C	2 043 757	884 734	(1 804 100)	1 124 391
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	LU0321462953	1C - EUR Hedged	624 683	49 742	(151 314)	523 111
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	LU2361257269	1D - EUR Hedged	56 837	130 215	(110 996)	76 056
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	LU1920015440	2C	158 346	1 206 566	(398 828)	966 084
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	LU0677077884	2D	17 503 092	5 448 770	(8 909 932)	14 041 930
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	LU0321463258	1C	765 946	296 000	(852 000)	209 946
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	LU0321463506	1C	212 977	11 518	(86 000)	138 495
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	LU0321465469	1C	1 098 780	1 480 565	(1 223 704)	1 355 641
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	LU0321464652	1D	428 222	187 495	(277 504)	338 213
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0378818131	1C - EUR Hedged	4 484 563	1 846 288	(2 855 603)	3 475 248
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0690964092	1D - EUR Hedged	1 069 460	305 926	(152 364)	1 223 022
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0641006290	2D - GBP Hedged	15 963 762	10 288 167	(6 067 558)	20 184 371
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0641006456	3C - USD Hedged	17 955 142	13 025 727	(5 423 076)	25 557 793
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0641006613	4C - CHF Hedged	1 003 539	1 155 398	(253 886)	1 905 051
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0908508731	5C	1 135 923	1 483 839	(1 184 614)	1 435 148
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0378818560	1C	826 495	0	(29 000)	797 495
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	LU1920015796	1C	10 145 802	22 591 530	(13 079 118)	19 658 214
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	LU0429459356	1D	4 222 697	8 028 968	(5 891 372)	6 360 293
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	LU2610432036	2C - GBP Hedged	0	1 112 703	(284 000)	828 703
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	LU1399300455	2D - EUR Hedged	15 420 255	11 765 528	(10 971 645)	16 214 138
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	LU1920015523	1C	163 566	4 280 284	(475 000)	3 968 850
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	LU0429458895	1D	579 422	717 124	(362 500)	934 046
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	LU0478205379	1C	15 455 262	21 839 270	(11 680 629)	25 613 903
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	LU0478205965	1D	304 279	1 777 499	(914 530)	1 167 248
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0643975161	1C	1 221 175	4 404 499	(3 551 261)	2 074 413
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0468896575	1D	265 683	3 986 032	(1 680 827)	2 570 888
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2523866379	2C - USD Hedged	301 392	71 506 488	(1 441 251)	70 366 629
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2523866296	2D - GBP Hedged	17 507	4 809 345	(456 980)	4 369 872
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	LU0468897110	1D	262 768	125 405	(94 000)	294 173
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	LU0484968903	1C	18 862 545	29 045 754	(16 590 865)	31 317 434
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	LU0484968812	1D	14 296 850	6 776 909	(5 472 692)	15 601 067

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des variations des Actions émises
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

Compartiment	Code ISIN	Catégorie d'actions	Nombre d'actions au 31 décembre 2022	Nombre d'actions émises	Nombre d'actions rachetées	Nombre d'actions au 31 décembre 2023
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	LU0484969463	1C	104 326	76 200	(123 163)	57 363
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	LU0524480265	1C	4 557 026	1 621 414	(1 340 181)	4 838 259
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	LU0962071741	1D	274 649	531 256	(158 138)	647 767
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0494592974	1C	596 319	477 000	(892 000)	181 319
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	LU0613540268	1C	3 511 334	836 343	(2 625 331)	1 722 346
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	LU0820950128	1C	16 193	0	0	16 193
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	LU0925589839	1C	6 001 368	2 017 760	(5 050 484)	2 968 644
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	LU2552296563	2D	0	23 186 098	(9 231 861)	13 954 237
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU0952581584	1C	41 758 190	9 423 000	(11 840 000)	39 341 190
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	LU0942970103	1D	5 777 090	4 975 523	(4 630 453)	6 122 160
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	LU0942970285	2C - USD Hedged	433 994	643 423	(723 051)	354 366
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	LU0942970368	3D - GBP Hedged	45 368	54 785	(44 746)	55 407
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	LU0942970442	4C - CHF Hedged	5 274 155	1 876 646	(919 875)	6 230 926
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	LU0942970798	5C - EUR Hedged	11 010 907	7 545 856	(5 190 052)	13 366 711
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	LU1109943388	1C	17 494 014	20 309 698	(16 366 635)	21 437 077
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	LU1109942653	1D	36 703 245	68 150 228	(48 705 362)	56 148 111
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	LU1109939865	1D	8 676 610	1 409 838	0	10 086 448
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU1094612022	1D	3 470 867	48 642	(2 100 000)	1 419 509
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	LU2178481649	1C	19 960 400	9 228 933	(5 283 000)	23 906 333
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2462217071	1C	181 558	2 487 542	(253 375)	2 415 725
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2385068163	1D	2 068 341	670 837	(2 383 556)	355 622
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2385068247	2D - GBP Hedged	2 040 729	635 288	(706 362)	1 969 655
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2385068320	3D - USD Hedged	180 694	197 105	(198 862)	178 937
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2385068593	4D - EUR Hedged	2 325 806	5 100 475	(3 211 611)	4 214 670
Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2468423459	1C	955 896	4 618 000	(2 705 000)	2 868 896
Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	LU2504532131	1C	90 404	345 000	(313 000)	122 404
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	LU2504532487	1D	130 048	121 500	(70 000)	181 548

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

État des variations des Actions émises
pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (suite)

Compartiment	Code ISIN	Catégorie d'actions	Nombre d'actions au 31 décembre 2022	Nombre d'actions émises	Nombre d'actions rachetées	Nombre d'actions au 31 décembre 2023
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	LU2504537445	1D	254 500	4 511 215	(2 183 000)	2 582 715
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	LU2158769930	1D	0	2 056 647	(945 000)	1 111 647
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	LU2641054122	1C	0	224 511	0	224 511
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF	LU2641053827	1C	0	270 765	(100 000)	170 765
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	LU2641054551	1C	0	7 816 351	(93 000)	7 723 351
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	LU2673523218	1D	0	1 005 458	0	1 005 458
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	LU2673523309	1D	0	925 955	0	925 955
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	LU2673523481	1D	0	980 431	(155 000)	825 431
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	LU2673523564	1D	0	585 731	0	585 731
Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF	LU2662649503	1D	0	38 000	0	38 000
Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF	LU2662649685	1D	0	72 310	0	72 310
Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF	LU2662649412	1D	0	73 140	0	73 140

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 6.25% 97 - 15.07.27	3 987 000	EUR	4 590 811	4 505 826	0,15
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.02.30	5 636 000	EUR	4 990 614	4 865 655	0,16
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.10.40	2 476 000	EUR	1 775 192	1 547 686	0,05
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.02.31	6 148 000	EUR	5 246 705	5 156 158	0,17
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.04.25	3 773 000	EUR	3 689 669	3 640 605	0,12
Austria 144A Zero Coupon 22 - 20.10.28	3 935 000	EUR	3 530 752	3 519 831	0,12
Austria 144A 0.25% 21 - 20.10.36	3 313 000	EUR	2 482 948	2 424 876	0,08
Austria 144A 0.50% 17 - 20.04.27	5 821 000	EUR	5 609 968	5 485 177	0,18
Austria 144A 0.50% 19 - 20.02.29	5 706 000	EUR	5 375 941	5 197 496	0,17
Austria 144A 0.50% 19 - 20.02.29	1 000	EUR	887	911	0,00
Austria 144A 0.70% 21 - 20.04.71	1 474 000	EUR	811 366	700 924	0,02
Austria 144A 0.75% 16 - 20.10.26	6 262 000	EUR	6 090 607	5 987 255	0,20
Austria 144A 0.75% 18 - 20.02.28	5 254 000	EUR	5 029 972	4 932 266	0,17
Austria 144A 0.75% 20 - 20.03.51	3 983 000	EUR	2 817 554	2 422 367	0,08
Austria 144A 0.85% 20 - 30.06.20	1 891 000	EUR	1 105 120	877 117	0,03
Austria 144A 0.90% 22 - 20.02.32	5 246 000	EUR	4 633 808	4 604 572	0,15
Austria 144A 1.20% 15 - 20.10.25	4 983 000	EUR	4 922 298	4 867 807	0,16
Austria 144A 1.50% 16 - 20.02.47	4 083 000	EUR	3 639 482	3 132 202	0,11
Austria 144A 1.50% 16 - 02.11.86	1 089 000	EUR	749 942	682 794	0,02
Austria 144A 1.85% 22 - 23.05.49	2 093 000	EUR	1 674 847	1 708 917	0,06
Austria 144A 2.00% 22 - 15.07.26	2 029 000	EUR	1 994 950	2 008 664	0,07
Austria 144A 2.10% 17 - 20.09.17	2 512 000	EUR	2 660 947	1 958 430	0,07
Austria 144A 2.40% 13 - 23.05.34	3 800 000	EUR	3 888 903	3 718 914	0,13
Austria 144A 2.90% 23 - 20.02.33	5 828 000	EUR	5 726 597	5 970 163	0,20
Austria 144A 2.90% 23 - 23.05.29	1 237 000	EUR	1 241 123	1 271 873	0,04
Austria 144A 3.15% 12 - 20.06.44	3 541 000	EUR	4 058 881	3 688 478	0,12
Austria 144A 3.15% 23 - 20.10.53	1 484 000	EUR	1 415 219	1 549 656	0,05
Austria 144A 3.45% 23 - 20.10.30	1 944 000	EUR	1 977 115	2 058 628	0,07
Austria 144A 3.80% 12 - 26.01.62	1 792 000	EUR	2 512 354	2 142 414	0,07
Austria 144A 4.15% 07 - 15.03.37	6 266 000	EUR	7 597 969	7 180 322	0,24
Austria 144A 4.85% 09 - 15.03.26	4 232 000	EUR	4 522 738	4 442 799	0,15
			106 365 279	102 250 783	3,41
Belgique					
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	4 142 780	EUR	5 108 906	4 579 633	0,15
Belgium 4.00% 12 - 28.03.32	3 845 280	EUR	4 363 171	4 272 558	0,14
Belgium 5.50% 98 - 28.03.28	8 388 212	EUR	9 635 676	9 475 943	0,32
Belgium 144A Zero Coupon 20 - 22.10.27	4 531 460	EUR	4 202 038	4 166 632	0,14
Belgium 144A Zero Coupon 21 - 22.10.31	5 916 440	EUR	5 160 359	4 892 393	0,16
Belgium 144A 0.10% 20 - 22.06.30	5 905 160	EUR	5 291 633	5 120 325	0,17
Belgium 144A 0.35% 22 - 22.06.32	6 766 910	EUR	5 743 289	5 656 776	0,19
Belgium 144A 0.40% 20 - 22.06.40	3 606 810	EUR	2 486 825	2 403 434	0,08
Belgium 144A 0.65% 21 - 22.06.71	2 675 000	EUR	1 458 429	1 207 174	0,04
Belgium 144A 0.80% 15 - 22.06.25	9 307 420	EUR	9 202 779	9 054 072	0,30
Belgium 144A 0.80% 17 - 22.06.27	6 999 981	EUR	6 758 775	6 660 989	0,22
Belgium 144A 0.80% 18 - 22.06.28	6 857 860	EUR	6 593 511	6 445 977	0,22
Belgium 144A 0.80% 18 - 22.06.28	314 000	EUR	291 320	295 141	0,01
Belgium 144A 0.90% 19 - 22.06.29	7 884 000	EUR	7 502 836	7 330 859	0,24
Belgium 144A 1.00% 15 - 22.06.31	6 985 850	EUR	6 516 694	6 309 235	0,21

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.00% 16 - 22.06.26	6 729 000	EUR	6 577 184	6 511 101	0,22
Belgium 144A 1.25% 18 - 22.04.33	4 544 000	EUR	4 238 105	4 063 654	0,14
Belgium 144A 1.40% 22 - 22.06.53	4 462 000	EUR	3 300 194	2 989 507	0,10
Belgium 144A 1.45% 17 - 22.06.37	2 820 000	EUR	2 683 906	2 381 767	0,08
Belgium 144A 1.60% 16 - 22.06.47	4 356 470	EUR	3 657 169	3 278 479	0,11
Belgium 144A 1.70% 19 - 22.06.50	4 627 650	EUR	3 981 131	3 448 067	0,12
Belgium 144A 1.90% 15 - 22.06.38	3 643 100	EUR	3 551 876	3 215 746	0,11
Belgium 144A 2.15% 16 - 22.06.66	3 628 600	EUR	3 482 636	2 873 483	0,10
Belgium 144A 2.25% 17 - 22.06.57	2 930 790	EUR	2 691 771	2 410 370	0,08
Belgium 144A 2.75% 22 - 22.04.39	2 250 000	EUR	2 121 418	2 196 007	0,07
Belgium 144A 3.00% 14 - 22.06.34	3 877 000	EUR	4 031 003	3 991 427	0,13
Belgium 144A 3.00% 14 - 22.06.34	44 000	EUR	42 885	45 299	0,00
Belgium 144A 3.00% 23 - 22.06.33	7 546 000	EUR	7 472 842	7 793 156	0,26
Belgium 144A 3.30% 23 - 22.06.54	4 471 870	EUR	4 157 132	4 561 095	0,15
Belgium 144A 3.45% 23 - 22.06.43	1 594 780	EUR	1 590 935	1 685 762	0,06
Belgium 144A 4.25% 10 - 28.03.41	7 214 160	EUR	8 942 748	8 432 822	0,28
Belgium 144A 4.50% 11 - 28.03.26	4 723 340	EUR	5 015 879	4 931 739	0,16
Belgium 144A 5.00% 04 - 28.03.35	8 353 230	EUR	10 543 680	10 166 602	0,34
			158 398 735	152 847 224	5,10
Croatie					
Croatia 0.50% 21 - 05.07.28	300 000	HRK	260 992	266 796	0,01
Croatia 1.125% 19 - 19.06.29	1 050 000	EUR	925 662	952 098	0,03
Croatia 1.125% 21 - 04.03.33	800 000	EUR	638 929	670 052	0,02
Croatia 1.50% 20 - 17.06.31	932 000	EUR	794 794	833 581	0,03
Croatia 1.75% 21 - 04.03.41	600 000	EUR	433 594	453 540	0,01
Croatia 2.375% 18 - 09.07.29	100 000	EUR	93 573	95 800	0,00
Croatia 2.75% 17 - 27.01.30	1 000 000	EUR	949 419	987 147	0,03
Croatia 2.875% 17 - 07.02.28	463 000	EUR	450 084	457 296	0,02
Croatia 2.875% 22 - 22.04.32	500 000	EUR	470 875	488 125	0,02
Croatia 3.00% 15 - 11.03.25	656 000	EUR	654 820	652 458	0,02
Croatia 3.00% 17 - 20.03.27	1 750 000	EUR	1 740 148	1 750 738	0,06
Croatia 4.00% 23 - 14.06.35	992 000	EUR	991 432	1 056 306	0,04
			8 404 322	8 663 937	0,29
Chypre					
Cyprus Zero Coupon 21 - 09.02.26	355 000	EUR	352 800	335 401	0,01
Cyprus 0.625% 20 - 21.01.30	447 000	EUR	400 165	392 737	0,01
Cyprus 0.95% 22 - 20.01.32	402 000	EUR	340 346	345 413	0,01
Cyprus 1.25% 20 - 21.01.40	473 000	EUR	418 175	341 979	0,01
Cyprus 1.50% 20 - 16.04.27	440 000	EUR	436 078	422 932	0,02
Cyprus 2.375% 18 - 25.09.28	655 000	EUR	689 102	643 033	0,02
Cyprus 2.75% 19 - 26.02.34	405 000	EUR	453 132	385 325	0,01
Cyprus 2.75% 19 - 03.05.49	496 000	EUR	513 855	416 466	0,02
Cyprus 4.125% 23 - 13.04.33	364 000	EUR	370 052	393 414	0,01
Cyprus 4.25% 15 - 04.11.25	576 000	EUR	598 451	591 581	0,02
			4 572 156	4 268 281	0,14

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Estonie					
Estonia 0.125% 20 - 10.06.30	509 000	EUR	495 005	422 177	0,01
Estonia 4.00% 22 - 12.10.32	762 000	EUR	771 281	820 299	0,03
			1 266 286	1 242 476	0,04
Finlande					
Finland 144A Zero Coupon 20 - 15.09.30	2 463 000	EUR	2 199 894	2 103 259	0,07
Finland 144A Zero Coupon 21 - 15.09.26	1 585 000	EUR	1 534 957	1 485 346	0,05
Finland 144A 0.125% 20 - 15.04.36	2 338 000	EUR	1 755 251	1 708 727	0,06
Finland 144A 0.125% 21 - 15.04.52	1 971 000	EUR	1 143 047	970 409	0,03
Finland 144A 0.125% 21 - 15.09.31	2 542 000	EUR	2 298 990	2 131 467	0,07
Finland 144A 0.25% 20 - 15.09.40	1 748 000	EUR	1 390 208	1 158 050	0,04
Finland 144A 0.50% 16 - 15.04.26	2 878 000	EUR	2 818 994	2 752 793	0,09
Finland 144A 0.50% 17 - 15.09.27	2 830 000	EUR	2 711 413	2 652 417	0,09
Finland 144A 0.50% 18 - 15.09.28	2 998 000	EUR	2 841 695	2 749 945	0,09
Finland 144A 0.50% 18 - 15.09.28	109 000	EUR	100 335	99 981	0,00
Finland 144A 0.50% 19 - 15.09.29	2 664 000	EUR	2 495 946	2 408 722	0,08
Finland 144A 0.50% 22 - 15.04.43	1 729 000	EUR	1 269 416	1 131 968	0,04
Finland 144A 0.75% 15 - 15.04.31	2 020 000	EUR	1 814 284	1 797 867	0,06
Finland 144A 0.875% 15 - 15.09.25	2 038 000	EUR	1 997 032	1 982 134	0,07
Finland 144A 1.125% 18 - 15.04.34	1 853 000	EUR	1 659 818	1 607 820	0,05
Finland 144A 1.375% 17 - 15.04.47	2 377 000	EUR	2 001 989	1 804 024	0,06
Finland 144A 1.375% 22 - 15.04.27	1 725 000	EUR	1 665 995	1 668 144	0,06
Finland 144A 1.50% 22 - 15.09.32	2 373 000	EUR	2 164 969	2 188 729	0,07
Finland 144A 2.625% 12 - 04.07.42	2 237 000	EUR	2 445 825	2 174 536	0,07
Finland 144A 2.75% 12 - 04.07.28	2 363 000	EUR	2 426 488	2 401 990	0,08
Finland 144A 2.75% 23 - 15.04.38	1 567 000	EUR	1 467 214	1 559 662	0,05
Finland 144A 2.875% 23 - 15.04.29	1 385 000	EUR	1 381 296	1 421 753	0,05
Finland 144A 3.00% 23 - 15.09.33	2 467 000	EUR	2 454 279	2 555 387	0,09
Finland 144A 4.00% 09 - 04.07.25	2 558 000	EUR	2 660 581	2 606 832	0,09
			46 699 916	45 121 962	1,51
France					
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	19 662 270	EUR	19 171 220	18 992 966	0,63
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	19 387 820	EUR	17 394 425	17 017 465	0,57
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	18 826 000	EUR	18 111 561	17 901 455	0,60
France OAT Zero Coupon 20 - 25.11.30	23 332 960	EUR	20 556 754	19 946 181	0,67
France OAT Zero Coupon 21 - 25.11.31	22 172 120	EUR	18 956 599	18 439 444	0,61
France OAT Zero Coupon 21 - 25.02.27	16 824 030	EUR	15 890 421	15 681 510	0,52
France OAT Zero Coupon 22 - 25.05.32	14 921 770	EUR	12 355 895	12 227 644	0,41
France OAT Zero Coupon 22 - 25.02.25	12 792 000	EUR	12 469 792	12 377 667	0,41
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	16 437 640	EUR	15 751 521	15 520 913	0,52
France OAT 0.50% 15 - 25.05.25	18 301 510	EUR	17 936 973	17 752 465	0,59
France OAT 0.50% 16 - 25.05.26	20 489 220	EUR	19 906 052	19 620 887	0,65
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	22 842 190	EUR	21 331 002	20 853 549	0,70
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	26 104 500	EUR	25 104 940	24 512 648	0,82
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	24 266 250	EUR	23 299 893	22 635 315	0,76
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	48 000	EUR	46 433	44 774	0,00
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	13 694 930	EUR	9 341 070	7 873 900	0,26
France OAT 0.75% 22 - 25.02.28	19 865 000	EUR	18 558 908	18 722 167	0,62
France OAT 0.75% 22 - 25.02.28	317 000	EUR	291 583	298 763	0,01

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.00% 15 - 25.11.25	15 361 660	EUR	15 237 389	14 949 660	0,50
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	54 000	EUR	52 336	52 552	0,00
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	17 243 477	EUR	16 751 221	16 543 392	0,55
France OAT 1.25% 18 - 25.05.34	18 754 890	EUR	17 215 517	16 513 681	0,55
France OAT 1.25% 22 - 25.05.38	6 578 700	EUR	5 136 266	5 370 193	0,18
France OAT 1.25% 22 - 25.05.38	50 000	EUR	40 181	40 815	0,00
France OAT 1.50% 15 - 25.05.31	25 258 000	EUR	24 424 137	23 869 820	0,80
France OAT 2.00% 22 - 25.11.32	19 260 190	EUR	18 104 988	18 573 372	0,62
France OAT 2.50% 14 - 25.05.30	25 597 480	EUR	26 468 620	25 941 254	0,87
France OAT 2.50% 23 - 24.09.26	19 365 250	EUR	19 125 434	19 445 809	0,65
France OAT 2.75% 12 - 25.10.27	23 454 150	EUR	24 236 610	23 886 879	0,80
France OAT 2.75% 23 - 25.02.29	13 742 300	EUR	13 637 950	14 067 099	0,47
France OAT 3.00% 23 - 25.05.33	15 500 000	EUR	15 419 293	16 153 015	0,54
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	12 514 090	EUR	14 101 518	13 093 242	0,44
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	18 325 090	EUR	19 060 889	18 792 380	0,63
France OAT 3.50% 23 - 25.11.33	5 910 000	EUR	6 050 307	6 401 830	0,21
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	10 939 250	EUR	13 119 904	12 542 725	0,42
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	8 055 400	EUR	10 571 357	9 662 936	0,32
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	15 858 280	EUR	20 698 870	19 378 025	0,65
France OAT 4.75% 04 - 25.04.35	11 753 600	EUR	14 490 447	14 175 899	0,47
France OAT 5.50% 98 - 25.04.29	16 194 992	EUR	19 144 119	18 769 672	0,63
France OAT 5.75% 01 - 25.10.32	14 381 514	EUR	18 637 739	18 092 807	0,60
France OAT 6.00% 94 - 25.10.25	12 791 030	EUR	13 715 835	13 569 236	0,45
France OAT 144A 0.50% 20 - 25.05.40	10 610 530	EUR	8 091 149	7 368 483	0,25
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.05.72	5 525 030	EUR	2 578 217	2 330 016	0,08
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.06.44	9 077 530	EUR	6 006 896	5 706 408	0,19
France OAT 144A 0.75% 21 - 25.05.53	12 723 280	EUR	7 903 072	7 171 858	0,24
France OAT 144A 1.25% 16 - 25.05.36	19 507 940	EUR	17 662 011	16 543 708	0,55
France OAT 144A 1.50% 19 - 25.05.50	13 581 310	EUR	11 258 267	9 895 750	0,33
France OAT 144A 1.75% 16 - 25.05.66	6 818 840	EUR	5 673 762	4 897 223	0,16
France OAT 144A 1.75% 17 - 25.06.39	13 297 400	EUR	12 205 271	11 587 620	0,39
France OAT 144A 2.00% 17 - 25.05.48	12 489 470	EUR	11 555 598	10 364 512	0,35
France OAT 144A 2.50% 22 - 25.05.43	5 469 080	EUR	4 787 385	5 101 394	0,17
France OAT 144A 3.00% 23 - 25.05.54	9 072 680	EUR	8 146 150	8 903 837	0,30
France OAT 144A 4.00% 05 - 25.04.55	8 276 080	EUR	10 983 612	9 803 348	0,33
			738 767 359	719 980 163	24,04
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	13 306 690	EUR	12 806 055	12 596 911	0,42
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	12 223 200	EUR	11 317 179	11 011 270	0,37
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	16 078 380	EUR	10 455 102	8 978 971	0,30
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	11 513 000	EUR	10 532 678	10 276 504	0,34
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	9 169 420	EUR	9 001 339	8 857 110	0,30

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 20 - 15.05.35	9 919 070	EUR	8 248 071	7 824 956	0,26
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	9 070 370	EUR	8 620 611	8 413 675	0,28
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	13 795 970	EUR	12 631 866	12 199 087	0,41
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	11 337 800	EUR	10 991 704	10 875 218	0,36
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	3 787 800	EUR	3 458 156	3 343 377	0,11
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	2 990 200	EUR	2 868 006	2 874 479	0,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.02.31	11 392 890	EUR	10 240 871	9 968 323	0,33
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	11 371 530	EUR	10 987 196	10 820 238	0,36
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.05.36	10 534 000	EUR	8 774 589	8 090 217	0,27
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.11.28	11 131 410	EUR	10 342 014	10 159 081	0,34
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	4 206 430	EUR	2 633 615	2 353 939	0,08
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	13 192 650	EUR	11 848 451	11 427 078	0,38
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	9 751 160	EUR	9 351 127	9 201 097	0,31
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	12 035 000	EUR	6 647 805	6 424 644	0,22
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	3 567 360	EUR	3 108 378	3 088 563	0,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.02.32	12 780 550	EUR	11 089 107	10 942 579	0,37
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 16.04.27	8 775 000	EUR	8 282 722	8 219 104	0,28
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.10.27	11 951 730	EUR	11 631 231	11 665 845	0,39
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	12 574 560	EUR	12 226 614	11 907 102	0,40
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	11 698 060	EUR	11 057 794	10 858 139	0,36
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	12 162 260	EUR	11 374 887	11 209 104	0,37
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	12 574 430	EUR	12 397 283	12 250 135	0,41
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	13 777 080	EUR	13 429 266	13 272 150	0,44
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	13 390 810	EUR	12 941 382	12 710 423	0,43
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	11 861 970	EUR	11 355 817	11 200 191	0,37
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	12 449 330	EUR	12 312 574	12 147 558	0,41
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 22 - 15.05.38	8 835 830	EUR	7 350 241	7 522 472	0,25
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	15 251 030	EUR	13 970 829	12 403 510	0,41
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	3 189 520	EUR	3 059 943	3 122 125	0,10
Bundesrepublik Deutschland 1.70% 22 - 15.08.32	11 254 390	EUR	10 897 179	11 027 164	0,37

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.80% 22 - 15.08.53	10 719 830	EUR	8 990 589	9 688 904	0,32
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	2 239 600	EUR	1 886 520	2 028 428	0,07
Bundesrepublik Deutschland 2.10% 22 - 15.11.29	10 833 540	EUR	10 670 149	10 941 984	0,37
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 23 - 13.04.28	9 851 460	EUR	9 754 289	9 942 512	0,33
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	15 809 460	EUR	15 652 243	16 222 245	0,54
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	2 419 720	EUR	2 385 709	2 484 811	0,08
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 19.10.28	12 153 320	EUR	12 050 510	12 405 258	0,41
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 15.11.30	5 356 000	EUR	5 316 721	5 517 001	0,18
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 04.07.44	12 409 086	EUR	14 231 947	12 842 163	0,43
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	12 932 100	EUR	14 790 449	13 449 513	0,45
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	7 340 630	EUR	7 298 954	7 312 442	0,24
Bundesrepublik Deutschland 2.60% 23 - 15.08.33	12 332 000	EUR	12 349 711	12 962 905	0,43
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	7 144 630	EUR	7 129 848	7 156 815	0,24
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	7 178 000	EUR	7 180 485	7 248 273	0,24
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	5 575 000	EUR	5 609 883	5 647 308	0,19
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 04.07.42	7 914 500	EUR	10 118 496	9 051 893	0,30
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 04.01.37	11 647 200	EUR	14 705 242	14 029 285	0,47
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 04.07.39	7 940 000	EUR	10 572 028	10 002 574	0,33
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 04.07.28	5 494 213	EUR	6 210 930	6 154 563	0,21
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 04.07.34	9 950 000	EUR	13 026 402	12 461 082	0,42
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	8 293 839	EUR	12 039 935	11 113 247	0,37
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	411 000	EUR	514 712	550 715	0,02
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 04.01.31	8 782 540	EUR	11 082 948	10 826 237	0,36
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 04.01.28	7 008 277	EUR	8 034 362	7 986 422	0,27
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 04.01.30	4 684 270	EUR	5 875 762	5 824 609	0,20
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 04.07.27	5 717 180	EUR	6 612 710	6 571 956	0,22
			572 333 216	559 665 484	18,69
Grèce					
Greece 3.75% 17 - 30.01.28	2 432 000	EUR	2 558 221	2 548 639	0,09
Greece 3.90% 17 - 30.01.33	2 882 000	EUR	3 093 308	3 063 508	0,10
Greece 4.00% 17 - 30.01.37	2 293 000	EUR	2 448 695	2 424 366	0,08
Greece 4.20% 17 - 30.01.42	2 333 000	EUR	2 528 389	2 485 228	0,08
Greece 144A Zero Coupon 21 - 12.02.26	2 200 000	EUR	2 096 930	2 093 080	0,07
Greece 144A 0.75% 21 - 18.06.31	2 447 000	EUR	2 110 048	2 091 231	0,07
Greece 144A 1.50% 20 - 18.06.30	2 243 000	EUR	2 078 812	2 063 134	0,07
Greece 144A 1.75% 22 - 18.06.32	1 509 000	EUR	1 381 640	1 376 208	0,05
Greece 144A 1.875% 19 - 23.07.26	1 019 000	EUR	1 011 296	1 009 187	0,03
Greece 144A 1.875% 20 - 04.02.35	1 835 000	EUR	1 606 176	1 586 137	0,05
Greece 144A 1.875% 21 - 24.01.52	1 427 000	EUR	1 036 002	1 021 718	0,04
Greece 144A 2.00% 20 - 22.04.27	1 600 000	EUR	1 594 528	1 590 624	0,05
Greece 144A 3.875% 19 - 12.03.29	1 631 000	EUR	1 741 908	1 730 784	0,06
Greece 144A 3.875% 23 - 15.06.28	1 183 000	EUR	1 253 365	1 249 556	0,04
Greece 144A 4.25% 23 - 15.06.33	1 917 000	EUR	2 113 109	2 099 163	0,07
Greece 144A 4.375% 23 - 18.07.38	1 427 000	EUR	1 583 171	1 571 562	0,05
			30 235 598	30 004 125	1,00
Irlande					
Ireland Zero Coupon 21 - 18.10.31	3 831 000	EUR	3 324 547	3 218 002	0,11
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	2 906 600	EUR	2 772 187	2 723 310	0,09

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Ireland 0.20% 20 - 18.10.30	3 361 000	EUR	3 000 458	2 929 011	0,10
Ireland 0.35% 22 - 18.10.32	2 172 000	EUR	1 906 790	1 824 154	0,06
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	2 339 000	EUR	1 926 894	1 862 499	0,06
Ireland 0.55% 21 - 22.04.41	1 768 000	EUR	1 316 081	1 236 769	0,04
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	3 467 500	EUR	3 320 571	3 291 732	0,11
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	4 830 000	EUR	4 761 981	4 688 336	0,16
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	4 277 320	EUR	4 171 039	4 045 789	0,14
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	2 065 000	EUR	1 931 683	1 881 690	0,06
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	2 810 000	EUR	2 687 378	2 637 180	0,09
Ireland 1.50% 19 - 15.05.50	3 721 860	EUR	3 048 347	2 821 281	0,09
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	3 053 000	EUR	2 862 832	2 733 381	0,09
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	4 488 350	EUR	4 259 202	3 867 387	0,13
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	3 901 140	EUR	3 996 040	3 944 560	0,13
Ireland 3.00% 23 - 18.10.43	1 395 000	EUR	1 352 720	1 439 896	0,05
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	4 718 490	EUR	4 916 875	4 852 448	0,16
			51 555 625	49 997 425	1,67
Italie					
Italy Zero Coupon 21 - 01.04.26	8 498 000	EUR	8 055 488	7 978 305	0,27
Italy Zero Coupon 21 - 01.08.26	7 849 000	EUR	7 388 913	7 308 610	0,24
Italy 0.25% 21 - 15.03.28	7 915 000	EUR	7 141 811	7 088 890	0,24
Italy 0.35% 19 - 01.02.25	7 630 000	EUR	7 465 665	7 396 334	0,25
Italy 0.35% 19 - 01.02.25	292 000	EUR	282 491	283 058	0,01
Italy 0.45% 21 - 15.02.29	6 563 000	EUR	5 764 392	5 764 305	0,19
Italy 0.50% 20 - 01.02.26	8 145 000	EUR	7 849 522	7 758 767	0,26
Italy 0.50% 21 - 15.07.28	6 926 000	EUR	6 357 807	6 214 769	0,21
Italy 0.85% 19 - 15.01.27	8 115 000	EUR	7 687 018	7 660 251	0,26
Italy 0.90% 20 - 01.04.31	9 898 000	EUR	8 569 447	8 366 639	0,28
Italy 0.95% 20 - 01.08.30	7 833 000	EUR	6 929 308	6 770 191	0,23
Italy 0.95% 20 - 15.09.27	8 585 000	EUR	8 070 891	8 019 764	0,27
Italy 0.95% 21 - 01.06.32	8 327 000	EUR	6 926 794	6 815 478	0,23
Italy 1.10% 22 - 01.04.27	5 804 000	EUR	5 452 676	5 496 794	0,18
Italy 1.20% 22 - 15.08.25	6 290 000	EUR	6 108 726	6 113 188	0,20
Italy 1.25% 16 - 01.12.26	8 132 000	EUR	7 867 040	7 788 159	0,26
Italy 1.35% 19 - 01.04.30	9 374 000	EUR	8 497 968	8 400 791	0,28
Italy 1.45% 18 - 15.05.25	5 715 000	EUR	5 625 970	5 593 476	0,19
Italy 1.45% 18 - 15.05.25	1 181 000	EUR	1 152 510	1 155 887	0,04
Italy 1.50% 15 - 01.06.25	8 251 000	EUR	8 210 966	8 073 551	0,27
Italy 1.60% 16 - 01.06.26	9 340 000	EUR	9 106 765	9 082 286	0,30
Italy 2.00% 15 - 01.12.25	8 444 000	EUR	8 379 353	8 307 781	0,28
Italy 2.00% 18 - 01.02.28	9 999 000	EUR	9 714 832	9 663 609	0,32
Italy 2.05% 17 - 01.08.27	7 833 000	EUR	7 679 271	7 627 227	0,25
Italy 2.10% 19 - 15.07.26	7 591 000	EUR	7 462 858	7 463 800	0,25
Italy 2.20% 17 - 01.06.27	7 856 000	EUR	7 742 825	7 699 587	0,26
Italy 2.50% 18 - 15.11.25	8 117 000	EUR	8 120 074	8 061 621	0,27
Italy 2.50% 22 - 01.12.32	7 895 000	EUR	7 028 981	7 286 169	0,24
Italy 2.65% 22 - 01.12.27	7 418 000	EUR	7 203 100	7 357 646	0,25
Italy 2.80% 18 - 01.12.28	9 148 000	EUR	9 079 811	9 066 674	0,30
Italy 2.80% 22 - 15.06.29	6 464 000	EUR	6 197 780	6 368 525	0,21

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.00% 19 - 01.08.29	9 388 000	EUR	9 392 452	9 348 892	0,31
Italy 3.40% 22 - 01.04.28	7 646 000	EUR	7 543 421	7 786 686	0,26
Italy 3.40% 23 - 28.03.25	5 919 000	EUR	5 903 580	5 932 850	0,20
Italy 3.50% 22 - 15.01.26	7 268 000	EUR	7 264 118	7 360 158	0,25
Italy 3.60% 23 - 29.09.25	5 227 000	EUR	5 214 970	5 280 211	0,18
Italy 3.70% 23 - 15.06.30	6 244 000	EUR	6 176 526	6 396 666	0,21
Italy 3.80% 23 - 15.04.26	6 617 000	EUR	6 655 851	6 756 155	0,23
Italy 3.80% 23 - 01.08.28	6 869 000	EUR	6 860 669	7 100 554	0,24
Italy 3.85% 22 - 15.12.29	7 751 000	EUR	7 714 489	8 021 122	0,27
Italy 3.85% 23 - 15.09.26	6 895 000	EUR	6 950 109	7 076 545	0,24
Italy 4.00% 23 - 15.11.30	5 453 000	EUR	5 452 017	5 675 701	0,19
Italy 4.10% 23 - 01.02.29	4 721 000	EUR	4 807 921	4 944 823	0,17
Italy 4.20% 23 - 01.03.34	6 421 000	EUR	6 346 208	6 683 747	0,22
Italy 4.35% 23 - 01.11.33	8 154 000	EUR	8 213 867	8 610 869	0,29
Italy 4.40% 22 - 01.05.33	8 612 000	EUR	8 701 263	9 174 172	0,31
Italy 5.20% 04 - 31.07.34	927 000	EUR	1 038 181	1 023 185	0,03
Italy 5.25% 98 - 01.11.29	12 728 290	EUR	14 243 482	14 159 586	0,47
Italy 5.75% 02 - 01.02.33	11 092 000	EUR	13 014 251	12 944 530	0,43
Italy 6.00% 00 - 01.05.31	13 173 000	EUR	15 511 785	15 483 544	0,52
Italy 6.50% 97 - 01.11.27	11 518 650	EUR	13 067 791	13 021 796	0,43
Italy 7.25% 97 - 01.11.26	5 351 100	EUR	5 996 903	5 992 750	0,20
Italy 144A 0.60% 21 - 01.08.31	8 786 000	EUR	7 442 075	7 176 929	0,24
Italy 144A 0.95% 21 - 01.03.37	6 977 000	EUR	5 317 495	4 887 388	0,16
Italy 144A 0.95% 21 - 01.12.31	8 359 000	EUR	7 045 914	6 949 698	0,23
Italy 144A 1.45% 20 - 01.03.36	6 041 000	EUR	4 858 222	4 646 345	0,16
Italy 144A 1.50% 21 - 30.04.45	5 632 000	EUR	3 927 987	3 558 314	0,12
Italy 144A 1.65% 15 - 01.03.32	10 446 000	EUR	9 302 503	9 111 419	0,30
Italy 144A 1.65% 20 - 01.12.30	9 513 000	EUR	8 800 794	8 546 827	0,29
Italy 144A 1.70% 20 - 01.09.51	6 748 000	EUR	4 731 534	4 136 910	0,14
Italy 144A 1.80% 20 - 01.03.41	6 728 000	EUR	5 311 966	4 849 018	0,16
Italy 144A 1.85% 20 - 01.07.25	7 266 000	EUR	7 214 460	7 140 305	0,24
Italy 144A 2.15% 21 - 01.03.72	2 472 000	EUR	1 588 085	1 501 509	0,05
Italy 144A 2.15% 22 - 01.09.52	3 755 000	EUR	2 777 049	2 497 601	0,08
Italy 144A 2.25% 16 - 01.09.36	6 999 000	EUR	6 185 644	5 857 446	0,20
Italy 144A 2.45% 17 - 01.09.33	8 082 000	EUR	7 536 891	7 342 292	0,25
Italy 144A 2.45% 20 - 01.09.50	6 393 000	EUR	5 149 811	4 671 813	0,16
Italy 144A 2.70% 16 - 01.03.47	7 692 000	EUR	6 581 471	6 069 372	0,20
Italy 144A 2.80% 16 - 01.03.67	3 879 000	EUR	3 178 634	2 836 402	0,09
Italy 144A 2.95% 18 - 01.09.38	6 316 000	EUR	5 802 662	5 598 861	0,19
Italy 144A 3.10% 19 - 01.03.40	5 889 000	EUR	5 602 669	5 212 998	0,17
Italy 144A 3.25% 15 - 01.09.46	7 388 000	EUR	6 653 628	6 398 377	0,21
Italy 144A 3.25% 22 - 01.03.38	4 949 000	EUR	4 403 927	4 541 876	0,15
Italy 144A 3.35% 19 - 01.03.35	6 599 000	EUR	6 552 365	6 344 812	0,21
Italy 144A 3.45% 17 - 01.03.48	7 264 000	EUR	7 022 474	6 433 580	0,21
Italy 144A 3.45% 17 - 01.03.48	145 000	EUR	124 122	128 424	0,00
Italy 144A 3.50% 14 - 01.03.30	11 713 000	EUR	11 924 658	11 938 814	0,40
Italy 144A 3.85% 19 - 01.09.49	6 287 000	EUR	6 412 072	5 936 185	0,20
Italy 144A 4.00% 05 - 01.02.37	13 085 000	EUR	13 682 773	13 239 848	0,44

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 4.00% 22 - 30.04.35	4 994 000	EUR	4 829 221	5 084 491	0,17
Italy 144A 4.00% 23 - 30.10.31	4 123 000	EUR	4 113 693	4 294 815	0,14
Italy 144A 4.45% 23 - 01.09.43	4 207 000	EUR	4 145 445	4 336 454	0,14
Italy 144A 4.50% 10 - 01.03.26	9 326 000	EUR	9 710 280	9 645 680	0,32
Italy 144A 4.50% 23 - 01.10.53	3 914 000	EUR	3 750 074	4 022 007	0,13
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.28	10 772 000	EUR	11 670 928	11 595 149	0,39
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.44	8 018 000	EUR	9 301 447	8 633 309	0,29
Italy 144A 5.00% 03 - 01.08.34	11 009 000	EUR	12 427 184	12 249 412	0,41
Italy 144A 5.00% 07 - 01.08.39	10 411 000	EUR	12 162 125	11 495 930	0,38
Italy 144A 5.00% 09 - 01.03.25	10 604 000	EUR	10 929 973	10 816 016	0,36
Italy 144A 5.00% 09 - 01.09.40	9 395 000	EUR	10 895 090	10 378 183	0,35
			644 258 252	636 911 483	21,27
Lettonie					
Latvia Zero Coupon 21 - 17.03.31	853 000	EUR	742 752	681 384	0,02
Latvia 0.375% 16 - 07.10.26	824 000	EUR	800 572	766 462	0,03
Latvia 1.375% 15 - 23.09.25	460 000	EUR	452 351	446 972	0,02
Latvia 1.875% 19 - 19.02.49	373 000	EUR	359 415	268 122	0,01
Latvia 2.25% 17 - 15.02.47	393 000	EUR	468 277	306 304	0,01
Latvia 3.50% 23 - 17.01.28	400 000	EUR	401 620	408 429	0,01
Latvia 3.875% 22 - 25.03.27	390 000	EUR	396 038	400 510	0,01
			3 621 025	3 278 183	0,11
Lituanie					
Lithuania 0.50% 20 - 28.07.50	628 000	EUR	495 682	312 092	0,01
Lithuania 0.75% 20 - 06.05.30	642 000	EUR	594 024	549 655	0,02
Lithuania 0.95% 17 - 26.05.27	616 000	EUR	582 284	571 241	0,02
Lithuania 2.125% 14 - 29.10.26	449 000	EUR	458 921	437 533	0,01
Lithuania 2.125% 15 - 22.10.35	486 000	EUR	485 406	425 687	0,01
Lithuania 2.125% 22 - 01.06.32	600 000	EUR	523 744	549 204	0,02
Lithuania 3.875% 23 - 14.06.33	468 000	EUR	470 713	489 843	0,02
			3 610 774	3 335 255	0,11
Luxembourg					
Luxembourg Zero Coupon 19 - 13.11.26	983 000	EUR	953 207	918 733	0,03
Luxembourg Zero Coupon 20 - 28.04.25	564 000	EUR	552 448	542 426	0,02
Luxembourg Zero Coupon 20 - 28.04.30	308 000	EUR	280 194	265 704	0,01
Luxembourg Zero Coupon 20 - 14.09.32	582 000	EUR	544 456	472 478	0,02
Luxembourg Zero Coupon 21 - 24.03.31	1 016 000	EUR	891 751	855 781	0,03
Luxembourg 0.625% 17 - 01.02.27	767 000	EUR	750 821	725 945	0,02
Luxembourg 1.375% 22 - 25.05.29	447 000	EUR	436 307	425 653	0,01
Luxembourg 1.75% 22 - 25.05.42	479 000	EUR	451 822	405 666	0,01
Luxembourg 3.00% 23 - 02.03.33	473 000	EUR	477 571	494 672	0,02
Luxembourg 3.25% 23 - 02.03.43	962 000	EUR	962 560	1 017 867	0,03
			6 301 137	6 124 925	0,20
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.07.30	5 817 210	EUR	5 282 538	5 061 496	0,17
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.27	6 449 930	EUR	6 098 402	6 038 811	0,20
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.52	7 306 000	EUR	4 327 042	3 768 435	0,13
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.07.31	5 986 000	EUR	5 206 821	5 083 970	0,17
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.38	4 277 000	EUR	3 249 106	3 028 971	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A Zero Coupon 21 - 15.01.29	4 716 670	EUR	4 282 164	4 239 508	0,14
Netherlands 144A Zero Coupon 22 - 15.01.26	6 153 600	EUR	5 869 361	5 849 305	0,20
Netherlands 144A 0.25% 15 - 15.07.25	8 182 420	EUR	8 056 727	7 901 518	0,26
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	90 000	EUR	79 869	81 280	0,00
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	5 030 400	EUR	4 706 647	4 543 005	0,15
Netherlands 144A 0.50% 16 - 15.07.26	7 818 870	EUR	7 604 643	7 486 333	0,25
Netherlands 144A 0.50% 19 - 15.01.40	6 555 140	EUR	5 149 714	4 860 309	0,16
Netherlands 144A 0.50% 22 - 15.07.32	5 678 300	EUR	4 995 836	4 903 155	0,16
Netherlands 144A 0.75% 17 - 15.07.27	7 259 300	EUR	7 012 856	6 921 234	0,23
Netherlands 144A 0.75% 18 - 15.07.28	7 986 090	EUR	7 684 184	7 517 067	0,25
Netherlands 144A 0.75% 18 - 15.07.28	16 000	EUR	15 605	15 060	0,00
Netherlands 144A 2.00% 22 - 15.01.54	3 470 000	EUR	2 986 795	3 132 508	0,11
Netherlands 144A 2.50% 12 - 15.01.33	6 357 540	EUR	6 730 261	6 474 392	0,22
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.07.33	4 998 000	EUR	4 794 367	5 076 069	0,17
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.01.30	3 216 100	EUR	3 176 004	3 277 367	0,11
Netherlands 144A 2.75% 14 - 15.01.47	8 427 220	EUR	9 962 363	8 834 676	0,30
Netherlands 144A 3.25% 23 - 15.01.44	1 986 000	EUR	1 962 519	2 211 709	0,07
Netherlands 144A 3.75% 10 - 15.01.42	7 618 200	EUR	9 718 895	8 989 171	0,30
Netherlands 144A 4.00% 05 - 15.01.37	7 347 410	EUR	9 036 168	8 581 554	0,29
Netherlands 144A 5.50% 98 - 15.01.28	5 299 394	EUR	6 049 044	5 973 265	0,20
			134 037 931	129 850 168	4,34
Portugal					
Portugal 144A 0.30% 21 - 17.10.31	3 607 000	EUR	3 055 110	3 047 699	0,10
Portugal 144A 0.475% 20 - 18.10.30	4 673 380	EUR	4 228 719	4 113 182	0,14
Portugal 144A 0.70% 20 - 15.10.27	3 252 120	EUR	3 105 101	3 076 278	0,10
Portugal 144A 0.90% 20 - 12.10.35	2 863 000	EUR	2 305 466	2 301 394	0,08
Portugal 144A 1.00% 21 - 12.04.52	2 259 000	EUR	1 376 259	1 313 609	0,04
Portugal 144A 1.15% 22 - 11.04.42	1 544 000	EUR	1 149 416	1 111 062	0,04
Portugal 144A 1.65% 22 - 16.07.32	2 922 130	EUR	2 615 404	2 709 370	0,09
Portugal 144A 1.95% 19 - 15.06.29	5 164 000	EUR	5 178 399	5 078 019	0,17
Portugal 144A 2.125% 18 - 17.10.28	6 456 200	EUR	6 520 654	6 427 341	0,22
Portugal 144A 2.25% 18 - 18.04.34	3 501 000	EUR	3 500 777	3 346 501	0,11
Portugal 144A 2.875% 15 - 15.10.25	5 531 700	EUR	5 618 108	5 575 069	0,19
Portugal 144A 2.875% 16 - 21.07.26	4 737 870	EUR	4 877 012	4 823 483	0,16
Portugal 144A 3.50% 23 - 18.06.38	1 314 660	EUR	1 310 132	1 373 254	0,05
Portugal 144A 3.875% 14 - 15.02.30	3 089 300	EUR	3 394 934	3 353 126	0,11
Portugal 144A 3.875% 14 - 15.02.30	45 000	EUR	47 789	48 843	0,00
Portugal 144A 4.10% 06 - 15.04.37	4 301 000	EUR	4 922 971	4 809 206	0,16
Portugal 144A 4.10% 15 - 15.02.45	2 191 000	EUR	2 594 484	2 487 902	0,08
Portugal 144A 4.125% 17 - 14.04.27	3 455 200	EUR	3 669 484	3 657 606	0,12
			59 470 219	58 652 944	1,96
Slovaquie					
Slovakia 0.125% 20 - 17.06.27	682 000	EUR	610 458	621 916	0,02
Slovakia 0.25% 20 - 14.05.25	1 206 300	EUR	1 173 481	1 158 772	0,04
Slovakia 0.375% 21 - 21.04.36	1 568 000	EUR	1 178 200	1 079 542	0,04
Slovakia 0.625% 16 - 22.05.26	578 000	EUR	550 690	548 681	0,02
Slovakia 0.75% 19 - 09.04.30	1 196 000	EUR	1 097 292	1 047 602	0,03
Slovakia 1.00% 18 - 12.06.28	1 196 000	EUR	1 134 312	1 103 434	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Slovaquie (suite)					
Slovakia 1.00% 20 - 09.10.30	1 194 000	EUR	1 100 203	1 048 657	0,04
Slovakia 1.00% 20 - 14.05.32	1 282 000	EUR	1 228 743	1 083 482	0,04
Slovakia 1.00% 21 - 13.10.51	643 000	EUR	447 186	332 476	0,01
Slovakia 1.375% 15 - 21.01.27	1 203 000	EUR	1 188 091	1 151 951	0,04
Slovakia 1.625% 16 - 21.01.31	1 049 000	EUR	1 031 737	957 894	0,03
Slovakia 1.875% 17 - 09.03.37	1 251 000	EUR	1 285 265	1 031 074	0,03
Slovakia 2.00% 17 - 17.10.47	1 289 000	EUR	1 253 330	950 641	0,03
Slovakia 3.625% 14 - 16.01.29	1 267 000	EUR	1 370 232	1 309 261	0,04
Slovakia 3.625% 23 - 08.06.33	1 199 000	EUR	1 187 998	1 239 358	0,04
Slovakia 3.75% 23 - 23.02.35	1 201 000	EUR	1 169 943	1 234 638	0,04
Slovakia 3.875% 13 - 08.02.33	525 000	EUR	577 752	555 678	0,02
Slovakia 4.00% 22 - 19.10.32	985 000	EUR	1 015 616	1 048 961	0,04
Slovakia 4.00% 23 - 23.02.43	623 000	EUR	596 239	646 321	0,02
Slovakia 4.35% 10 - 14.10.25	1 249 000	EUR	1 301 963	1 274 917	0,04
Slovakia 4.50% 06 - 10.05.26	624 047	EUR	660 083	643 564	0,02
			21 158 814	20 068 820	0,67
Slovénie					
Slovenia Zero Coupon 21 - 12.02.31	787 000	EUR	720 056	645 939	0,02
Slovenia Zero Coupon 22 - 13.02.26	469 000	EUR	441 662	440 927	0,02
Slovenia 0.125% 21 - 01.07.31	489 000	EUR	427 624	401 356	0,01
Slovenia 0.275% 20 - 14.01.30	622 000	EUR	547 632	536 040	0,02
Slovenia 0.488% 20 - 20.10.50	714 000	EUR	507 842	368 090	0,01
Slovenia 0.875% 20 - 15.07.30	476 000	EUR	417 266	422 328	0,01
Slovenia 1.00% 18 - 06.03.28	937 000	EUR	923 228	876 729	0,03
Slovenia 1.188% 19 - 14.03.29	1 050 000	EUR	1 049 659	971 334	0,03
Slovenia 1.25% 17 - 22.03.27	1 196 000	EUR	1 168 410	1 141 576	0,04
Slovenia 1.50% 15 - 25.03.35	1 099 000	EUR	1 024 644	928 364	0,03
Slovenia 1.75% 16 - 03.11.40	1 236 000	EUR	1 108 280	1 000 208	0,03
Slovenia 2.125% 15 - 28.07.25	856 000	EUR	862 706	845 345	0,03
Slovenia 2.25% 16 - 03.03.32	1 571 000	EUR	1 556 281	1 504 790	0,05
Slovenia 3.125% 15 - 07.08.45	872 000	EUR	894 199	863 797	0,03
Slovenia 3.625% 23 - 11.03.33	460 000	EUR	461 172	485 795	0,02
Slovenia 5.125% 11 - 30.03.26	781 000	EUR	840 000	817 605	0,03
			12 950 661	12 250 223	0,41
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	8 925 000	EUR	8 759 841	8 637 347	0,29
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	8 038 000	EUR	7 806 289	7 607 364	0,25
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	464 000	EUR	439 421	439 141	0,01
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	11 565 000	EUR	10 581 645	10 453 835	0,35
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	111 000	EUR	96 846	100 335	0,00
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.27	9 233 000	EUR	8 547 615	8 543 873	0,29
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	8 082 000	EUR	7 798 737	7 758 801	0,26
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	11 312 000	EUR	10 077 349	10 255 516	0,34
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	9 717 000	EUR	9 620 576	9 759 658	0,33
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	9 735 000	EUR	12 120 575	11 902 595	0,40
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	10 804 670	EUR	12 742 990	12 567 884	0,42
Spain 144A 0.10% 21 - 30.04.31	9 877 000	EUR	8 392 229	8 160 687	0,27
Spain 144A 0.50% 20 - 30.04.30	10 571 000	EUR	9 638 564	9 270 450	0,31

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 0.50% 21 - 31.10.31	9 788 000	EUR	8 487 086	8 230 584	0,28
Spain 144A 0.60% 19 - 31.10.29	10 013 000	EUR	9 152 221	8 943 111	0,30
Spain 144A 0.70% 22 - 30.04.32	10 210 000	EUR	8 701 092	8 613 020	0,29
Spain 144A 0.80% 20 - 30.07.27	9 549 000	EUR	9 125 462	8 995 444	0,30
Spain 144A 0.85% 21 - 30.07.37	5 942 000	EUR	4 699 759	4 391 376	0,15
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	9 248 000	EUR	5 702 972	5 210 115	0,17
Spain 144A 1.00% 21 - 30.07.42	4 714 000	EUR	3 223 077	3 165 215	0,11
Spain 144A 1.20% 20 - 31.10.40	8 133 000	EUR	6 272 639	5 857 143	0,20
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	10 236 000	EUR	9 632 104	9 309 978	0,31
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	76 000	EUR	66 468	69 124	0,00
Spain 144A 1.30% 16 - 31.10.26	11 802 000	EUR	11 573 509	11 409 702	0,38
Spain 144A 1.40% 18 - 30.04.28	11 439 000	EUR	11 010 652	10 921 728	0,36
Spain 144A 1.40% 18 - 30.07.28	10 158 000	EUR	9 798 306	9 673 463	0,32
Spain 144A 1.45% 17 - 31.10.27	10 316 000	EUR	10 037 091	9 922 857	0,33
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	8 699 000	EUR	8 379 524	8 224 557	0,27
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	149 000	EUR	137 994	140 874	0,00
Spain 144A 1.45% 21 - 31.10.71	3 283 000	EUR	1 864 977	1 665 564	0,06
Spain 144A 1.50% 17 - 30.04.27	10 488 000	EUR	10 240 727	10 149 972	0,34
Spain 144A 1.60% 15 - 30.04.25	9 120 000	EUR	9 061 341	8 961 859	0,30
Spain 144A 1.85% 19 - 30.07.35	8 932 000	EUR	8 323 320	7 873 737	0,26
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	7 585 000	EUR	5 403 816	5 266 948	0,18
Spain 144A 1.95% 15 - 30.07.30	9 626 000	EUR	9 313 685	9 219 205	0,31
Spain 144A 1.95% 16 - 30.04.26	9 005 000	EUR	8 990 943	8 869 835	0,30
Spain 144A 2.15% 15 - 31.10.25	11 008 000	EUR	11 028 691	10 906 506	0,36
Spain 144A 2.35% 17 - 30.07.33	8 442 000	EUR	8 390 834	8 046 999	0,27
Spain 144A 2.55% 22 - 31.10.32	9 607 000	EUR	9 171 017	9 364 087	0,31
Spain 144A 2.70% 18 - 31.10.48	7 782 000	EUR	7 383 736	6 720 224	0,22
Spain 144A 2.90% 16 - 31.10.46	8 274 000	EUR	8 299 415	7 509 482	0,25
Spain 144A 3.15% 23 - 30.04.33	10 026 000	EUR	9 708 687	10 191 266	0,34
Spain 144A 3.45% 16 - 30.07.66	6 088 000	EUR	6 330 413	5 670 347	0,19
Spain 144A 3.45% 22 - 30.07.43	4 843 000	EUR	4 543 551	4 798 467	0,16
Spain 144A 3.50% 23 - 31.05.29	2 779 000	EUR	2 806 626	2 901 642	0,10
Spain 144A 3.55% 23 - 31.10.33	10 267 000	EUR	10 214 986	10 750 340	0,36
Spain 144A 3.90% 23 - 30.07.39	3 909 000	EUR	3 913 497	4 141 682	0,14
Spain 144A 4.00% 14 - 31.10.64	312 000	EUR	395 094	325 273	0,01
Spain 144A 4.20% 05 - 31.01.37	9 135 000	EUR	10 429 491	10 132 177	0,34
Spain 144A 4.65% 10 - 30.07.25	9 973 000	EUR	10 386 526	10 241 772	0,34
Spain 144A 4.70% 09 - 30.07.41	8 855 000	EUR	11 097 392	10 390 546	0,35
Spain 144A 4.90% 07 - 30.07.40	8 487 000	EUR	10 655 605	10 088 327	0,34
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.28	8 680 000	EUR	9 860 224	9 705 976	0,32
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.44	6 593 000	EUR	8 599 021	8 230 174	0,27
Spain 144A 5.90% 11 - 30.07.26	10 278 000	EUR	11 306 832	11 109 387	0,37
			430 343 080	421 767 571	14,08
Total - Obligations			3 034 350 385	2 966 281 432	99,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	411	EUR	4 127 375	4 130 395	0,14
			4 127 375	4 130 395	0,14
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			4 127 375	4 130 395	0,14
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			3 038 477 760	2 970 411 827	99,18
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			3 038 477 760	2 970 411 827	99,18
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				2 998 945 602	100,13

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 - 25.03.25	136 862 000	EUR	132 771 368	132 203 218	7,36
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	130 493 000	EUR	122 795 927	124 084 489	6,91
France OAT Zero Coupon 22 - 25.02.25	90 296 500	EUR	87 705 166	87 371 796	4,87
France OAT 2.50% 23 - 24.09.26	136 484 000	EUR	134 482 528	137 051 773	7,63
			477 754 989	480 711 276	26,77
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	65 366 500	EUR	63 423 131	63 140 117	3,51
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	79 581 000	EUR	76 115 214	76 334 095	4,25
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	21 336 000	EUR	20 414 759	20 510 297	1,14
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	80 654 000	EUR	76 146 030	76 743 894	4,27
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	68 274 000	EUR	63 423 029	64 422 664	3,59
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	50 064 500	EUR	49 808 238	49 872 252	2,78
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	49 783 000	EUR	49 685 551	49 867 905	2,78
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	48 361 000	EUR	48 426 132	48 834 454	2,72
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	41 249 000	EUR	41 552 698	41 784 000	2,33
			488 994 782	491 509 678	27,37
Italie					
Italy Zero Coupon 21 - 01.04.26	59 160 000	EUR	54 822 744	55 542 070	3,09
Italy Zero Coupon 21 - 01.08.26	52 796 000	EUR	48 339 842	49 161 085	2,74
Italy 0.35% 19 - 01.02.25	54 640 000	EUR	53 219 873	52 966 672	2,95
Italy 0.50% 20 - 01.02.26	55 618 000	EUR	52 317 464	52 980 611	2,95
Italy 1.20% 22 - 15.08.25	44 025 000	EUR	42 605 471	42 787 457	2,38
Italy 3.40% 23 - 28.03.25	43 866 000	EUR	43 791 066	43 968 646	2,45
Italy 3.50% 22 - 15.01.26	49 286 000	EUR	49 384 880	49 910 947	2,78
Italy 3.60% 23 - 29.09.25	35 560 000	EUR	35 531 585	35 922 001	2,00
Italy 3.80% 23 - 15.04.26	45 969 000	EUR	46 296 300	46 935 728	2,61
Italy 3.85% 23 - 15.09.26	53 201 000	EUR	53 726 268	54 601 782	3,04
Italy 144A 1.85% 20 - 01.07.25	50 149 000	EUR	49 219 310	49 281 473	2,75
			529 254 803	534 058 472	29,74
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 22 - 15.01.26	42 375 000	EUR	40 104 235	40 279 556	2,24
			40 104 235	40 279 556	2,24
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	60 820 000	EUR	59 190 719	58 859 771	3,28
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	61 686 000	EUR	57 904 475	58 381 173	3,25
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	58 307 000	EUR	56 038 519	55 975 303	3,12
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	67 190 000	EUR	66 447 259	67 484 964	3,76
			239 580 972	240 701 211	13,41
Total - Obligations			1 775 689 781	1 787 260 193	99,53

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	90	EUR	903 139	904 466	0,05
			903 139	904 466	0,05
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			903 139	904 466	0,05
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 776 592 920	1 788 164 659	99,58
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 776 592 920	1 788 164 659	99,58
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 796 497 802	100,04

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 21 - 25.02.27	30 494 000	EUR	28 614 788	28 423 153	8,23
France OAT 0.75% 22 - 25.02.28	36 737 000	EUR	33 610 546	34 623 520	10,02
			62 225 334	63 046 673	18,25
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	16 237 000	EUR	14 905 194	15 061 441	4,36
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.11.28	19 927 000	EUR	17 816 185	18 186 377	5,27
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 16.04.27	16 237 000	EUR	15 261 902	15 208 386	4,40
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.10.27	22 141 000	EUR	21 320 974	21 611 387	6,26
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	5 904 000	EUR	5 684 216	5 779 249	1,67
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 23 - 13.04.28	18 451 000	EUR	18 279 752	18 621 533	5,39
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 19.10.28	21 817 000	EUR	21 618 655	22 269 266	6,45
			114 886 878	116 737 639	33,80
Italie					
Italy 0.25% 21 - 15.03.28	14 245 000	EUR	12 403 367	12 758 211	3,69
Italy 0.50% 21 - 15.07.28	12 174 000	EUR	10 581 674	10 923 852	3,16
Italy 0.85% 19 - 15.01.27	14 329 000	EUR	13 544 432	13 526 030	3,92
Italy 0.85% 19 - 15.01.27	315 000	EUR	300 561	297 348	0,09
Italy 0.95% 20 - 15.09.27	15 892 000	EUR	14 434 628	14 845 671	4,30
Italy 1.10% 22 - 01.04.27	10 554 000	EUR	9 918 736	9 995 377	2,89
Italy 2.65% 22 - 01.12.27	13 137 000	EUR	12 606 624	13 030 115	3,77
Italy 3.40% 22 - 01.04.28	13 506 000	EUR	13 356 390	13 754 510	3,98
Italy 3.80% 23 - 01.08.28	13 034 000	EUR	13 042 555	13 473 376	3,90
			100 188 967	102 604 490	29,70
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.27	11 633 000	EUR	10 998 099	10 891 513	3,15
			10 998 099	10 891 513	3,15
Espagne					
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	20 966 000	EUR	18 400 160	18 951 587	5,49
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.27	16 820 000	EUR	15 620 942	15 564 599	4,50
Spain 144A 0.80% 20 - 30.07.27	17 081 000	EUR	16 123 165	16 090 814	4,66
			50 144 267	50 607 000	14,65
Total - Obligations			338 443 545	343 887 315	99,55

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	10	EUR	100 145	100 496	0,03
			100 145	100 496	0,03
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			100 145	100 496	0,03
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			338 543 690	343 987 811	99,58
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			338 543 690	343 987 811	99,58
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				345 540 586	100,03

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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	42 263 000	EUR	36 477 529	37 095 926	6,17
France OAT Zero Coupon 20 - 25.11.30	51 423 000	EUR	42 890 988	43 958 952	7,32
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	50 579 000	EUR	45 703 403	46 175 592	7,68
France OAT 2.75% 23 - 25.02.29	30 166 000	EUR	30 192 270	30 878 973	5,14
			155 264 190	158 109 443	26,31
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	26 179 000	EUR	23 300 606	23 583 352	3,93
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	24 919 000	EUR	21 665 275	22 242 700	3,70
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	30 378 000	EUR	26 190 415	26 861 747	4,47
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	8 208 000	EUR	7 087 463	7 244 955	1,21
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	26 172 000	EUR	23 925 520	24 120 900	4,01
Bundesrepublik Deutschland 2.10% 22 - 15.11.29	23 610 000	EUR	23 394 936	23 846 336	3,97
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 15.11.30	11 947 000	EUR	12 058 589	12 306 127	2,05
			137 622 804	140 206 117	23,34
Italie					
Italy 0.45% 21 - 15.02.29	14 231 000	EUR	12 326 941	12 499 136	2,08
Italy 0.95% 20 - 01.08.30	16 924 000	EUR	14 269 270	14 627 692	2,44
Italy 1.35% 19 - 01.04.30	20 734 000	EUR	18 095 993	18 581 396	3,09
Italy 2.80% 22 - 15.06.29	13 919 000	EUR	13 418 168	13 713 414	2,28
Italy 3.00% 19 - 01.08.29	20 289 000	EUR	19 781 897	20 204 482	3,36
Italy 3.70% 23 - 15.06.30	13 575 000	EUR	13 585 062	13 906 909	2,32
Italy 3.85% 22 - 15.12.29	16 567 000	EUR	16 709 899	17 144 360	2,85
Italy 4.00% 23 - 15.11.30	12 766 000	EUR	13 114 559	13 287 363	2,21
Italy 4.10% 23 - 01.02.29	11 322 000	EUR	11 640 201	11 858 776	1,98
Italy 144A 1.65% 20 - 01.12.30	20 551 000	EUR	18 596 600	18 463 770	3,07
			151 538 590	154 287 298	25,68
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.07.30	12 596 000	EUR	10 659 663	10 959 654	1,82
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.29	11 072 000	EUR	9 867 846	9 951 901	1,66
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	1 529 000	EUR	1 353 490	1 380 855	0,23
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	9 281 000	EUR	8 322 550	8 381 764	1,39
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.01.30	7 282 000	EUR	7 273 181	7 420 722	1,24
			37 476 730	38 094 896	6,34
Espagne					
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	23 251 000	EUR	20 737 699	21 079 473	3,51
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	1 073 000	EUR	948 525	972 787	0,16
Spain 144A 0.50% 20 - 30.04.30	22 953 000	EUR	19 669 223	20 129 092	3,35
Spain 144A 0.60% 19 - 31.10.29	23 181 000	EUR	20 389 372	20 704 110	3,44
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	22 808 000	EUR	20 294 788	20 744 624	3,45
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	12 258 000	EUR	11 463 446	11 589 449	1,93

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.45% 19 - 30.04.29	6 532 000	EUR	6 052 045	6 175 745	1,03
Spain 144A 3.50% 23 - 31.05.29	5 973 000	EUR	6 094 654	6 236 598	1,04
			105 649 752	107 631 878	17,91
Total - Obligations			587 552 066	598 329 632	99,58
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	1 142	EUR	11 469 945	11 476 669	1,91
			11 469 945	11 476 669	1,91
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			11 469 945	11 476 669	1,91
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			599 022 011	609 806 301	101,49
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			599 022 011	609 806 301	101,49
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				612 387 225	101,93

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 21 - 25.11.31	72 934 000	EUR	59 044 844	60 655 561	6,55
France OAT Zero Coupon 22 - 25.05.32	50 185 000	EUR	40 007 835	41 124 098	4,44
France OAT 2.00% 22 - 25.11.32	62 157 000	EUR	57 768 497	59 940 482	6,48
France OAT 3.00% 23 - 25.05.33	51 363 000	EUR	51 036 257	53 526 923	5,78
France OAT 3.50% 23 - 25.11.33	19 246 000	EUR	20 043 923	20 847 652	2,25
			227 901 356	236 094 716	25,50
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.02.31	37 600 000	EUR	32 251 306	32 898 496	3,55
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	43 469 000	EUR	36 796 471	37 651 544	4,07
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	11 996 000	EUR	10 192 285	10 385 944	1,12
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.02.32	41 207 000	EUR	34 421 957	35 281 021	3,81
Bundesrepublik Deutschland 1.70% 22 - 15.08.32	37 941 000	EUR	36 054 087	37 174 971	4,02
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	51 342 000	EUR	50 571 415	52 682 539	5,69
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	8 330 000	EUR	8 245 741	8 554 077	0,93
Bundesrepublik Deutschland 2.60% 23 - 15.08.33	41 504 000	EUR	41 746 646	43 627 345	4,71
			250 279 908	258 255 937	27,90
Italie					
Italy 0.90% 20 - 01.04.31	32 288 000	EUR	26 436 108	27 292 588	2,95
Italy 0.95% 21 - 01.06.32	28 185 000	EUR	22 138 344	23 068 842	2,49
Italy 2.50% 22 - 01.12.32	25 414 000	EUR	22 162 924	23 454 174	2,53
Italy 4.35% 23 - 01.11.33	26 868 000	EUR	27 397 079	28 373 414	3,07
Italy 4.40% 22 - 01.05.33	28 930 000	EUR	29 439 230	30 818 487	3,33
Italy 144A 0.60% 21 - 01.08.31	28 863 000	EUR	22 872 613	23 577 021	2,55
Italy 144A 0.95% 21 - 01.12.31	27 636 000	EUR	22 273 176	22 976 653	2,48
Italy 144A 4.00% 23 - 30.10.31	13 328 000	EUR	13 598 826	13 883 410	1,50
			186 318 300	193 444 589	20,90
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.07.31	19 879 000	EUR	16 517 001	16 883 434	1,82
Netherlands 144A 0.50% 22 - 15.07.32	18 100 000	EUR	15 254 566	15 629 169	1,69
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.07.33	16 869 000	EUR	16 287 871	17 132 494	1,85
			48 059 438	49 645 097	5,36
Espagne					
Spain 144A 0.10% 21 - 30.04.31	32 667 000	EUR	26 326 859	26 990 498	2,92
Spain 144A 0.50% 21 - 31.10.31	31 842 000	EUR	26 064 428	26 775 467	2,89
Spain 144A 0.70% 22 - 30.04.32	32 999 000	EUR	26 989 427	27 837 517	3,01
Spain 144A 2.55% 22 - 31.10.32	31 421 000	EUR	29 522 924	30 626 520	3,31
Spain 144A 3.15% 23 - 30.04.33	32 731 000	EUR	31 921 175	33 270 528	3,59
Spain 144A 3.55% 23 - 31.10.33	33 809 000	EUR	34 061 520	35 400 626	3,82
			174 886 333	180 901 156	19,54
Total - Obligations			887 445 335	918 341 495	99,20

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	111	EUR	1 113 873	1 115 508	0,12
			1 113 873	1 115 508	0,12
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			1 113 873	1 115 508	0,12
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			888 559 208	919 457 003	99,32
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			888 559 208	919 457 003	99,32
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				924 834 457	99,90

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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	1 827 000	EUR	1 060 208	1 050 434	2,03
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	1 645 000	EUR	1 776 680	1 721 131	3,33
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	2 087 000	EUR	2 594 014	2 550 210	4,94
France OAT 144A 0.50% 20 - 25.05.40	1 389 000	EUR	1 003 225	964 591	1,87
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.06.44	1 212 000	EUR	787 983	761 899	1,48
France OAT 144A 0.75% 21 - 25.05.53	1 681 000	EUR	871 372	947 546	1,83
France OAT 144A 1.50% 19 - 25.05.50	1 802 000	EUR	1 428 098	1 312 991	2,54
France OAT 144A 1.75% 17 - 25.06.39	1 767 000	EUR	1 586 890	1 539 799	2,98
France OAT 144A 2.00% 17 - 25.05.48	1 664 300	EUR	1 457 260	1 381 136	2,67
France OAT 144A 2.50% 22 - 25.05.43	731 000	EUR	640 132	681 855	1,32
			13 205 862	12 911 592	24,99
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	2 146 000	EUR	1 294 133	1 198 434	2,32
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	549 000	EUR	333 309	307 223	0,60
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	1 600 000	EUR	833 633	854 128	1,65
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	2 037 000	EUR	1 758 210	1 656 672	3,21
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 22 - 15.08.53	1 396 000	EUR	1 135 545	1 261 747	2,44
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	297 000	EUR	245 295	268 996	0,52
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 04.07.44	1 654 000	EUR	1 797 918	1 711 724	3,31
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	1 697 500	EUR	1 876 459	1 765 417	3,42
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 04.07.42	1 059 000	EUR	1 272 137	1 211 189	2,34
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 04.07.39	1 036 400	EUR	1 347 752	1 305 625	2,53
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	1 156 000	EUR	1 589 795	1 548 970	3,00
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	5 000	EUR	6 526	6 700	0,01
			13 490 712	13 096 825	25,35
Italie					
Italy 144A 1.50% 21 - 30.04.45	714 000	EUR	488 036	451 107	0,87
Italy 144A 1.70% 20 - 01.09.51	889 000	EUR	578 139	545 008	1,05
Italy 144A 1.80% 20 - 01.03.41	911 000	EUR	688 071	656 578	1,27
Italy 144A 2.15% 22 - 01.09.52	490 000	EUR	314 923	325 919	0,63
Italy 144A 2.45% 20 - 01.09.50	853 000	EUR	662 540	623 347	1,21
Italy 144A 2.70% 16 - 01.03.47	1 016 000	EUR	823 971	801 675	1,55
Italy 144A 3.10% 19 - 01.03.40	780 000	EUR	706 814	690 463	1,34
Italy 144A 3.25% 15 - 01.09.46	971 000	EUR	865 806	840 935	1,63
Italy 144A 3.45% 17 - 01.03.48	997 000	EUR	914 326	883 023	1,71
Italy 144A 3.85% 19 - 01.09.49	847 000	EUR	833 549	799 737	1,55
Italy 144A 4.45% 23 - 01.09.43	538 000	EUR	524 478	554 555	1,07
Italy 144A 4.50% 23 - 01.10.53	516 000	EUR	467 531	530 239	1,02
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.44	1 058 000	EUR	1 146 161	1 139 192	2,20
Italy 144A 5.00% 07 - 01.08.39	1 421 000	EUR	1 579 502	1 569 082	3,04
Italy 144A 5.00% 09 - 01.09.40	1 257 000	EUR	1 392 498	1 388 544	2,69
			11 986 345	11 799 404	22,83
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.52	966 000	EUR	529 822	498 263	0,97
Netherlands 144A 0.50% 19 - 15.01.40	855 000	EUR	653 597	633 940	1,23

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 2.75% 14 - 15.01.47	1 108 000	EUR	1 225 954	1 161 572	2,25
Netherlands 144A 3.25% 23 - 15.01.44	271 000	EUR	267 606	301 799	0,58
Netherlands 144A 3.75% 10 - 15.01.42	1 013 000	EUR	1 237 013	1 195 299	2,31
			3 913 992	3 790 873	7,34
Espagne					
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	1 228 000	EUR	736 892	691 828	1,34
Spain 144A 1.00% 21 - 30.07.42	612 000	EUR	407 485	410 927	0,80
Spain 144A 1.20% 20 - 31.10.40	1 066 000	EUR	799 271	767 701	1,49
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	1 007 000	EUR	673 606	699 251	1,35
Spain 144A 2.70% 18 - 31.10.48	1 024 000	EUR	925 021	884 285	1,71
Spain 144A 2.90% 16 - 31.10.46	1 076 000	EUR	1 013 285	976 578	1,89
Spain 144A 3.45% 22 - 30.07.43	638 000	EUR	599 637	632 133	1,22
Spain 144A 3.90% 23 - 30.07.39	552 000	EUR	555 196	584 858	1,13
Spain 144A 4.70% 09 - 30.07.41	1 160 000	EUR	1 382 609	1 361 156	2,63
Spain 144A 4.90% 07 - 30.07.40	1 128 000	EUR	1 364 212	1 340 831	2,60
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.44	879 000	EUR	1 126 124	1 097 273	2,12
			9 583 338	9 446 821	18,28
Total - Obligations			52 180 249	51 045 515	98,79
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			52 180 249	51 045 515	98,79
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			52 180 249	51 045 515	98,79
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				51 667 932	100,00

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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	12 117 000	EUR	7 639 312	6 966 669	5,55
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	7 218 200	EUR	9 239 057	8 658 664	6,90
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.05.72	4 796 000	EUR	2 116 137	2 022 569	1,61
France OAT 144A 0.75% 21 - 25.05.53	11 233 000	EUR	6 665 502	6 331 818	5,05
France OAT 144A 1.50% 19 - 25.05.50	11 954 000	EUR	9 473 374	8 710 043	6,94
France OAT 144A 1.75% 16 - 25.05.66	6 064 400	EUR	4 797 597	4 355 392	3,47
France OAT 144A 3.00% 23 - 25.05.54	7 936 000	EUR	7 162 937	7 788 311	6,21
France OAT 144A 4.00% 05 - 25.04.55	7 250 300	EUR	9 308 699	8 588 270	6,85
			56 402 615	53 421 736	42,58
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	14 203 000	EUR	8 693 328	7 931 665	6,32
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	3 604 000	EUR	2 213 678	2 016 816	1,61
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	10 675 640	EUR	5 915 851	5 698 977	4,54
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 22 - 15.08.53	9 335 000	EUR	7 858 115	8 437 253	6,72
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	2 015 000	EUR	1 730 371	1 825 006	1,46
			26 411 343	25 909 717	20,65
Italie					
Italy 144A 1.70% 20 - 01.09.51	5 931 000	EUR	3 905 329	3 636 042	2,90
Italy 144A 2.15% 21 - 01.03.72	2 122 000	EUR	1 376 795	1 288 916	1,03
Italy 144A 2.15% 22 - 01.09.52	3 328 000	EUR	2 362 562	2 213 586	1,76
Italy 144A 2.45% 20 - 01.09.50	5 642 000	EUR	4 390 084	4 123 004	3,29
Italy 144A 2.80% 16 - 01.03.67	3 476 000	EUR	2 710 781	2 541 721	2,03
Italy 144A 3.85% 19 - 01.09.49	5 562 000	EUR	5 514 626	5 251 641	4,18
Italy 144A 4.50% 23 - 01.10.53	3 483 000	EUR	3 363 322	3 579 113	2,85
			23 623 499	22 634 023	18,04
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.52	6 423 000	EUR	3 546 214	3 312 983	2,64
Netherlands 144A 2.00% 22 - 15.01.54	3 106 000	EUR	2 684 668	2 803 911	2,23
			6 230 882	6 116 894	4,87
Espagne					
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	8 151 000	EUR	4 956 885	4 592 090	3,66
Spain 144A 1.45% 21 - 31.10.71	2 830 000	EUR	1 519 526	1 435 744	1,14
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	6 679 000	EUR	4 578 142	4 637 831	3,70
Spain 144A 3.45% 16 - 30.07.66	5 657 000	EUR	5 694 518	5 268 915	4,20
Spain 144A 4.00% 14 - 31.10.64	85 000	EUR	111 843	88 616	0,07
			16 860 914	16 023 196	12,77
Total - Obligations			129 529 253	124 105 566	98,91

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	1	EUR	10 034	10 050	0,01
			10 034	10 050	0,01
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			10 034	10 050	0,01
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			129 539 287	124 115 616	98,92
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			129 539 287	124 115 616	98,92
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				125 467 074	100,00

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

Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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% 21 - 21.11.32	1 932 000	AUD	1 283 119	1 233 663	0,11
Australia 0.75% 17 - 21.11.27	2 779 000	AUD	1 972 906	2 073 335	0,18
Australia 1.00% 18 - 21.02.50	1 651 000	AUD	1 195 295	1 061 045	0,09
Australia 1.25% 15 - 21.08.40	1 857 000	AUD	1 480 593	1 385 089	0,12
Australia 2.00% 13 - 21.08.35	1 781 000	AUD	1 584 050	1 530 773	0,14
Australia 2.50% 10 - 20.09.30	2 794 000	AUD	2 682 852	2 634 234	0,23
Australia 3.00% 09 - 20.09.25	2 980 000	AUD	2 790 211	2 759 400	0,24
			12 989 026	12 677 539	1,11
Canada					
Canada 0.25% 21 - 01.12.54	931 118	CAD	587 995	471 935	0,04
Canada 0.50% 17 - 01.12.50	3 614 499	CAD	2 470 196	1 977 167	0,18
Canada 1.25% 13 - 01.12.47	3 870 687	CAD	3 056 242	2 502 940	0,22
Canada 1.50% 10 - 01.12.44	4 125 424	CAD	3 264 609	2 791 488	0,25
Canada 2.00% 07 - 01.12.41	3 630 571	CAD	3 036 771	2 641 538	0,23
Canada 3.00% 03 - 01.12.36	3 517 132	CAD	3 214 462	2 870 972	0,25
Canada 4.00% 99 - 01.12.31	3 847 670	CAD	3 309 902	3 170 159	0,28
Canada 4.25% 95 - 01.12.26	3 548 417	CAD	2 698 956	2 644 470	0,23
			21 639 133	19 070 669	1,68
Danemark					
Denmark 0.10% 18 - 15.11.30	7 714 032	DKK	1 102 494	1 012 579	0,09
Denmark 0.10% 22 - 15.11.34	5 385 414	DKK	696 304	687 264	0,06
			1 798 798	1 699 843	0,15
France					
France OAT 0.10% 15 - 01.03.25	5 734 161	EUR	5 827 687	5 652 736	0,50
France OAT 0.10% 17 - 01.03.28	6 891 988	EUR	7 180 987	6 803 426	0,60
France OAT 0.10% 19 - 01.03.29	7 752 903	EUR	7 942 512	7 696 385	0,68
France OAT 0.60% 23 - 25.07.34	1 116 738	EUR	1 120 734	1 130 083	0,10
France OAT 1.85% 11 - 25.07.27	12 122 134	EUR	13 274 388	12 821 218	1,13
France OAT 3.15% 02 - 25.07.32	6 846 896	EUR	8 934 416	8 449 617	0,74
France OAT 3.40% 99 - 25.07.29	5 308 678	EUR	6 529 193	6 203 191	0,54
France OAT 144A 0.10% 16 - 25.07.47	6 291 750	EUR	7 067 334	5 551 714	0,49
France OAT 144A 0.10% 18 - 25.07.36	6 081 287	EUR	6 515 580	5 750 769	0,50
France OAT 144A 0.10% 20 - 01.03.26	5 853 432	EUR	6 029 885	5 798 176	0,51
France OAT 144A 0.10% 20 - 01.03.36	3 399 152	EUR	3 641 396	3 220 255	0,28
France OAT 144A 0.10% 21 - 25.07.31	5 383 423	EUR	5 858 328	5 308 702	0,47
France OAT 144A 0.10% 21 - 01.03.32	2 959 528	EUR	3 125 446	2 897 586	0,25
France OAT 144A 0.10% 22 - 25.07.53	2 772 381	EUR	3 073 672	2 414 716	0,21
France OAT 144A 0.10% 22 - 25.07.38	3 096 426	EUR	3 077 841	2 902 744	0,25
France OAT 144A 0.55% 23 - 01.03.39	1 200 012	EUR	1 194 614	1 185 144	0,10
France OAT 144A 0.70% 14 - 25.07.30	8 362 015	EUR	9 146 630	8 622 157	0,76
France OAT 144A 1.80% 07 - 25.07.40	7 116 494	EUR	9 658 986	8 456 814	0,74
			109 199 629	100 865 433	8,85
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland 0.10% 15 - 15.04.26	9 223 837	EUR	9 499 684	9 072 197	0,80
Bundesrepublik Deutschland 0.10% 15 - 15.04.46	6 963 459	EUR	8 598 174	6 945 284	0,61
Bundesrepublik Deutschland 0.10% 21 - 15.04.33	4 948 831	EUR	5 365 520	4 978 722	0,44
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 14 - 15.04.30	10 805 377	EUR	11 876 604	11 100 256	0,97
			35 339 982	32 096 459	2,82

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Italy 0.65% 20 - 15.05.26	4 377 242	EUR	4 481 310	4 311 452	0,38
Italy 1.50% 23 - 15.05.29	2 973 178	EUR	2 921 950	2 981 563	0,26
Italy 144A 0.10% 22 - 15.05.33	7 818 692	EUR	7 114 282	6 694 677	0,59
Italy 144A 0.15% 21 - 15.05.51	3 133 521	EUR	2 895 484	1 988 282	0,17
Italy 144A 0.40% 19 - 15.05.30	6 467 057	EUR	6 510 884	6 045 469	0,53
Italy 144A 1.25% 15 - 15.09.32	7 061 153	EUR	7 333 896	6 855 603	0,60
Italy 144A 1.30% 17 - 15.05.28	7 596 512	EUR	7 858 201	7 593 777	0,67
Italy 144A 2.35% 04 - 15.09.35	7 537 770	EUR	8 712 404	8 011 293	0,70
Italy 144A 2.40% 23 - 15.05.39	1 520 651	EUR	1 567 011	1 577 249	0,14
Italy 144A 2.55% 09 - 15.09.41	7 453 947	EUR	8 879 087	7 987 128	0,70
Italy 144A 3.10% 11 - 15.09.26	6 343 885	EUR	6 793 278	6 690 197	0,59
			65 067 787	60 736 690	5,33
Japon					
Japan 0.005% 21 - 10.03.31	315 045 834	JPY	2 425 771	2 168 270	0,19
Japan 0.005% 22 - 10.03.32	372 246 044	JPY	2 748 174	2 562 351	0,23
Japan 0.005% 23 - 10.03.33	296 388 752	JPY	2 003 031	2 019 139	0,18
Japan 0.10% 15 - 10.03.25	747 131 000	JPY	5 790 654	4 918 056	0,43
Japan 0.10% 16 - 10.03.26	601 964 493	JPY	4 695 732	4 019 537	0,35
Japan 0.10% 17 - 10.03.27	582 188 606	JPY	4 570 511	3 987 599	0,35
Japan 0.10% 18 - 10.03.28	578 062 191	JPY	4 535 244	3 909 152	0,34
Japan 0.10% 19 - 10.03.29	579 101 455	JPY	4 615 744	3 929 157	0,35
Japan 0.20% 20 - 10.03.30	216 192 660	JPY	1 696 865	1 530 000	0,13
			33 081 726	29 043 261	2,55
Nouvelle-Zélande					
New Zealand 2.00% 12 - 20.09.25	1 356 000	NZD	954 017	1 016 963	0,09
New Zealand 2.50% 14 - 20.09.35	2 781 000	NZD	2 151 630	2 046 223	0,18
New Zealand 2.50% 17 - 20.09.40	1 879 000	NZD	1 494 632	1 341 888	0,12
New Zealand 3.00% 13 - 20.09.30	1 859 000	NZD	1 465 815	1 446 026	0,12
			6 066 094	5 851 100	0,51
Espagne					
Spain 144A 0.65% 17 - 30.11.27	7 592 529	EUR	7 886 774	7 575 825	0,66
Spain 144A 0.70% 18 - 30.11.33	9 060 680	EUR	9 617 310	8 766 842	0,77
Spain 144A 1.00% 15 - 30.11.30	8 370 721	EUR	8 980 927	8 457 357	0,74
Spain 144A 2.05% 23 - 30.11.39	1 204 684	EUR	1 221 833	1 317 105	0,12
			27 706 844	26 117 129	2,29
Suède					
Sweden 0.125% 15 - 01.06.32	9 865 000	SEK	1 196 865	1 131 411	0,10
Sweden 0.125% 16 - 01.06.26	13 235 000	SEK	1 520 131	1 518 783	0,13
Sweden 0.125% 17 - 01.12.27	10 055 000	SEK	1 171 249	1 134 379	0,10
Sweden 0.125% 20 - 01.06.30	8 430 000	SEK	953 164	896 886	0,08
Sweden 0.125% 21 - 01.06.39	2 820 000	SEK	333 113	283 132	0,03
Sweden 1.00% 14 - 01.06.25	13 075 000	SEK	1 554 739	1 518 568	0,13
Sweden 3.50% 99 - 01.12.28	10 995 000	SEK	2 082 796	1 794 627	0,16
			8 812 057	8 277 786	0,73
Royaume-Uni					
United Kingdom 0.125% 11 - 22.03.29	9 591 168	GBP	12 093 832	11 169 775	0,98
United Kingdom 0.125% 12 - 22.03.44	9 478 347	GBP	14 235 747	9 430 016	0,83
United Kingdom 0.125% 13 - 22.03.68	7 491 015	GBP	16 734 928	6 462 550	0,57

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.125% 14 - 22.03.58	6 263 288	GBP	11 633 067	5 512 958	0,48
United Kingdom 0.125% 15 - 22.03.46	7 866 808	GBP	12 714 226	7 615 892	0,67
United Kingdom 0.125% 15 - 22.03.26	7 469 583	GBP	8 976 980	8 587 799	0,75
United Kingdom 0.125% 16 - 22.11.65	4 544 699	GBP	9 741 236	3 921 425	0,34
United Kingdom 0.125% 16 - 22.11.36	7 898 414	GBP	11 198 659	8 802 273	0,77
United Kingdom 0.125% 16 - 22.11.56	4 000 583	GBP	7 245 586	3 586 464	0,31
United Kingdom 0.125% 17 - 10.08.48	6 179 702	GBP	10 259 801	5 855 084	0,51
United Kingdom 0.125% 18 - 10.08.28	9 434 492	GBP	11 884 568	11 024 438	0,97
United Kingdom 0.125% 18 - 10.08.41	6 694 375	GBP	10 395 382	6 948 711	0,61
United Kingdom 0.125% 21 - 10.08.31	5 759 896	GBP	7 551 665	6 746 069	0,59
United Kingdom 0.125% 21 - 22.03.51	5 071 680	GBP	7 277 053	4 668 075	0,41
United Kingdom 0.125% 21 - 22.03.39	5 068 967	GBP	6 726 203	5 393 111	0,47
United Kingdom 0.125% 21 - 22.03.73	2 084 422	GBP	4 489 886	1 922 801	0,17
United Kingdom 0.25% 12 - 22.03.52	7 490 938	GBP	12 953 549	7 119 313	0,63
United Kingdom 0.375% 11 - 22.03.62	7 792 854	GBP	16 230 607	7 445 012	0,65
United Kingdom 0.50% 09 - 22.03.50	8 423 896	GBP	15 034 709	8 663 253	0,76
United Kingdom 0.625% 09 - 22.11.42	8 653 967	GBP	14 083 885	9 710 800	0,85
United Kingdom 0.625% 10 - 22.03.40	9 465 289	GBP	14 680 109	10 825 904	0,95
United Kingdom 0.625% 23 - 22.03.45	3 166 327	GBP	3 472 547	3 473 199	0,31
United Kingdom 0.75% 07 - 22.11.47	8 331 586	GBP	14 488 554	9 200 788	0,81
United Kingdom 0.75% 11 - 22.03.34	9 079 779	GBP	13 171 629	11 018 393	0,97
United Kingdom 0.75% 23 - 22.11.33	2 605 422	GBP	3 063 225	3 184 223	0,28
United Kingdom 1.125% 07 - 22.11.37	9 498 435	GBP	15 092 770	11 889 918	1,04
United Kingdom 1.25% 05 - 22.11.55	7 747 440	GBP	17 252 826	9 663 552	0,85
United Kingdom 1.25% 06 - 22.11.27	10 727 480	GBP	13 734 790	13 063 575	1,15
United Kingdom 1.25% 08 - 22.11.32	9 959 347	GBP	14 408 555	12 717 893	1,12
United Kingdom 2.00% 02 - 26.01.35	3 576 443	GBP	11 494 315	10 427 847	0,92
United Kingdom 4.125% 92 - 22.07.30	1 890 367	GBP	8 076 704	7 651 296	0,67
			350 397 593	243 702 407	21,39
États-Unis					
United States Zero Coupon 20 - 15.10.25	15 774 431	USD	13 960 452	13 738 881	1,21
United States Zero Coupon 21 - 15.10.26	16 701 216	USD	15 324 453	14 371 868	1,26
United States Zero Coupon 22 - 15.01.32	22 005 472	USD	20 378 856	17 561 513	1,54
United States Zero Coupon 22 - 15.02.52	8 352 374	USD	6 936 544	4 688 301	0,41
United States Zero Coupon 22 - 15.04.27	16 707 434	USD	15 827 178	14 232 169	1,25
United States Zero Coupon 22 - 15.07.32	20 035 334	USD	18 896 082	16 635 590	1,46
United States Zero Coupon 22 - 15.10.27	16 092 688	USD	15 546 352	14 476 592	1,27
United States Zero Coupon 23 - 15.01.33	19 940 135	USD	18 154 920	17 146 334	1,51
United States Zero Coupon 23 - 15.02.53	8 048 627	USD	7 101 885	6 659 776	0,58
United States 0.125% 16 - 15.07.26	18 494 462	USD	16 671 332	15 967 729	1,40
United States 0.125% 20 - 15.04.25	16 362 828	USD	14 730 510	14 293 397	1,25
United States 0.125% 20 - 15.07.30	20 102 735	USD	18 117 949	16 489 350	1,45
United States 0.125% 21 - 15.01.31	19 871 789	USD	17 755 699	16 110 087	1,41
United States 0.125% 21 - 15.02.51	8 318 479	USD	7 377 584	4 710 647	0,41
United States 0.125% 21 - 15.04.26	18 225 817	USD	16 110 720	15 717 520	1,38
United States 0.125% 21 - 15.07.31	20 922 537	USD	19 435 073	16 897 311	1,48
United States 0.25% 15 - 15.01.25	20 553 586	USD	18 307 465	18 069 383	1,59
United States 0.25% 19 - 15.07.29	18 723 096	USD	17 021 711	15 707 379	1,38

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.25% 20 - 15.02.50	7 267 802	USD	6 533 008	4 330 763	0,38
United States 0.375% 15 - 15.07.25	20 821 645	USD	18 638 528	18 273 619	1,60
United States 0.375% 17 - 15.01.27	18 982 588	USD	17 024 925	16 355 646	1,44
United States 0.375% 17 - 15.07.27	18 282 064	USD	16 443 161	15 747 281	1,38
United States 0.50% 18 - 15.01.28	18 757 000	USD	16 718 709	16 094 253	1,41
United States 0.625% 13 - 15.02.43	11 869 699	USD	10 614 303	8 452 808	0,74
United States 0.625% 16 - 15.01.26	21 448 356	USD	19 296 124	18 753 015	1,65
United States 0.75% 12 - 15.02.42	12 175 968	USD	11 284 479	9 001 932	0,79
United States 0.75% 15 - 15.02.45	11 693 499	USD	10 956 772	8 342 580	0,73
United States 0.75% 18 - 15.07.28	17 624 505	USD	16 030 186	15 303 730	1,34
United States 0.875% 17 - 15.02.47	9 510 916	USD	9 174 369	6 841 311	0,60
United States 0.875% 19 - 15.01.29	17 297 826	USD	15 968 130	15 022 741	1,32
United States 1.00% 16 - 15.02.46	10 217 975	USD	9 739 388	7 629 502	0,67
United States 1.00% 18 - 15.02.48	8 921 233	USD	8 564 699	6 571 472	0,58
United States 1.25% 23 - 15.04.28	16 017 242	USD	14 365 521	14 148 451	1,24
United States 1.375% 14 - 15.02.44	11 866 390	USD	12 097 788	9 667 959	0,85
United States 1.375% 23 - 15.07.33	18 724 388	USD	16 395 326	16 496 127	1,45
United States 1.375% 23 - 15.07.33	19 094 297	USD	17 349 777	15 711 494	1,38
United States 1.50% 23 - 15.02.53	7 301 964	USD	7 176 289	5 364 760	0,47
United States 1.75% 08 - 15.01.28	8 922 282	USD	8 409 527	8 044 167	0,71
United States 2.00% 06 - 15.01.26	11 976 381	USD	11 027 867	10 764 633	0,94
United States 2.125% 10 - 15.02.40	8 405 056	USD	9 186 994	7 858 460	0,69
United States 2.125% 11 - 15.02.41	13 267 694	USD	14 728 087	12 415 869	1,09
United States 2.375% 04 - 15.01.25	17 756 377	USD	16 147 614	15 959 585	1,40
United States 2.375% 07 - 15.01.27	9 785 101	USD	9 254 501	8 948 097	0,79
United States 2.375% 23 - 15.10.28	16 234 288	USD	15 197 214	15 161 566	1,33
United States 2.50% 09 - 15.01.29	7 733 741	USD	7 632 566	7 255 543	0,64
United States 3.375% 01 - 15.04.32	3 380 958	USD	3 673 395	3 437 266	0,30
United States 3.625% 98 - 15.04.28	12 466 972	USD	12 586 295	12 115 885	1,06
United States 3.875% 99 - 15.04.29	14 088 506	USD	14 753 455	14 100 108	1,24
			654 623 762	597 644 450	52,45
Total - Obligations			1 326 722 431	1 137 782 766	99,86

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	18	EUR	180 656	180 893	0,01
			180 656	180 893	0,01
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			180 656	180 893	0,01
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 326 903 087	1 137 963 659	99,87
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 326 903 087	1 137 963 659	99,87
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 141 202 040	100,16

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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% 15 - 01.03.25	13 266 950	EUR	13 460 580	13 078 559	2,56
France OAT 0.10% 15 - 01.03.25	203 749	EUR	204 311	200 856	0,04
France OAT 0.10% 17 - 01.03.28	16 038 169	EUR	16 686 755	15 832 079	3,10
France OAT 0.10% 19 - 01.03.29	18 117 215	EUR	18 514 788	17 985 141	3,52
France OAT 0.60% 23 - 25.07.34	2 731 118	EUR	2 737 113	2 763 755	0,54
France OAT 1.85% 11 - 25.07.27	28 014 089	EUR	30 624 080	29 629 662	5,80
France OAT 3.15% 02 - 25.07.32	15 854 402	EUR	20 674 100	19 565 600	3,83
France OAT 3.40% 99 - 25.07.29	12 178 964	EUR	14 989 150	14 231 120	2,78
France OAT 144A 0.10% 16 - 25.07.47	14 471 757	EUR	15 610 246	12 769 589	2,50
France OAT 144A 0.10% 18 - 25.07.36	13 923 975	EUR	14 420 105	13 167 207	2,58
France OAT 144A 0.10% 20 - 01.03.26	13 467 855	EUR	13 807 202	13 340 719	2,61
France OAT 144A 0.10% 20 - 01.03.36	7 934 448	EUR	8 213 660	7 516 858	1,47
France OAT 144A 0.10% 21 - 25.07.31	12 532 931	EUR	13 207 224	12 358 974	2,42
France OAT 144A 0.10% 21 - 01.03.32	6 789 526	EUR	7 044 976	6 647 421	1,30
France OAT 144A 0.10% 22 - 25.07.53	6 391 459	EUR	6 623 636	5 566 897	1,09
France OAT 144A 0.10% 22 - 25.07.38	7 033 741	EUR	6 896 101	6 593 781	1,29
France OAT 144A 0.55% 23 - 01.03.39	2 797 956	EUR	2 758 986	2 763 289	0,54
France OAT 144A 0.70% 14 - 25.07.30	19 190 224	EUR	21 565 965	19 787 232	3,87
France OAT 144A 0.70% 14 - 25.07.30	134 215	EUR	132 198	138 390	0,03
France OAT 144A 1.80% 07 - 25.07.40	16 540 842	EUR	21 937 574	19 656 144	3,85
			250 108 750	233 593 273	45,72
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland 0.10% 15 - 15.04.26	21 538 500	EUR	22 118 231	21 184 407	4,14
Bundesrepublik Deutschland 0.10% 15 - 15.04.46	16 130 192	EUR	19 528 130	16 088 092	3,15
Bundesrepublik Deutschland 0.10% 21 - 15.04.33	11 422 481	EUR	12 178 144	11 491 473	2,25
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 14 - 15.04.30	24 954 815	EUR	27 418 607	25 635 832	5,02
			81 243 112	74 399 804	14,56
Italie					
Italy 0.65% 20 - 15.05.26	9 982 666	EUR	10 143 029	9 832 626	1,92
Italy 1.50% 23 - 15.05.29	6 897 322	EUR	6 775 315	6 916 772	1,35
Italy 144A 0.10% 22 - 15.05.33	17 987 484	EUR	16 005 444	15 401 604	3,01
Italy 144A 0.15% 21 - 15.05.51	7 294 912	EUR	6 098 341	4 628 768	0,91
Italy 144A 0.40% 19 - 15.05.30	14 842 328	EUR	14 794 631	13 874 756	2,71
Italy 144A 1.25% 15 - 15.09.32	16 317 155	EUR	17 031 888	15 842 163	3,10
Italy 144A 1.30% 17 - 15.05.28	17 727 669	EUR	18 416 195	17 721 287	3,47
Italy 144A 2.35% 04 - 15.09.35	17 482 945	EUR	20 152 756	18 581 224	3,64
Italy 144A 2.40% 23 - 15.05.39	3 691 694	EUR	3 790 974	3 829 099	0,75
Italy 144A 2.55% 09 - 15.09.41	17 072 986	EUR	20 471 325	18 294 217	3,58
Italy 144A 3.10% 11 - 15.09.26	14 907 538	EUR	16 125 262	15 721 340	3,08
			149 805 160	140 643 856	27,52
Espagne					
Spain 144A 0.65% 17 - 30.11.27	17 834 475	EUR	18 416 978	17 795 239	3,48
Spain 144A 0.70% 18 - 30.11.33	20 780 556	EUR	21 550 646	20 106 642	3,94

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.00% 15 - 30.11.30	19 429 378	EUR	20 687 674	19 630 472	3,84
Spain 144A 2.05% 23 - 30.11.39	2 866 604	EUR	2 910 694	3 134 116	0,61
			63 565 992	60 666 469	11,87
Total - Obligations			544 723 014	509 303 402	99,67
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			544 723 014	509 303 402	99,67
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			544 723 014	509 303 402	99,67
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				510 927 682	99,99

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 2.50% 22 - 25.05.43	50 000 000	EUR	46 645 682	46 506 000	0,98
			46 645 682	46 506 000	0,98
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 00 - 04.01.31	69 560 000	EUR	61 248 276	60 787 788	1,27
			61 248 276	60 787 788	1,27
Espagne					
Spain Zero Coupon 05 - 31.01.37	100 000 000	EUR	66 453 000	65 485 000	1,37
			66 453 000	65 485 000	1,37
Supranationales					
European Union 0.45% 21 - 04.07.41	68 500 000	EUR	45 298 698	44 953 810	0,94
European Union 2.50% 22 - 04.10.52	55 000 000	EUR	49 378 926	48 861 450	1,02
European Union 2.625% 22 - 04.02.48	608 300 000	EUR	571 499 324	566 448 960	11,87
			666 176 948	660 264 220	13,83
Royaume-Uni					
United Kingdom 0.125% 11 - 22.03.29	119 674 294	GBP	137 032 750	139 364 532	2,92
United Kingdom 0.125% 12 - 22.03.44	60 003 768	GBP	59 774 095	59 619 560	1,25
United Kingdom 0.125% 15 - 22.03.46	21 966 563	GBP	21 430 370	21 232 211	0,45
United Kingdom 0.125% 15 - 22.03.26	60 476 221	GBP	69 307 439	69 519 898	1,46
United Kingdom 0.125% 16 - 22.11.65	14 565 329	GBP	12 787 723	12 553 843	0,26
United Kingdom 0.125% 18 - 10.08.28	111 247 240	GBP	128 342 594	129 987 460	2,72
United Kingdom 0.125% 18 - 10.08.41	191 435 871	GBP	189 344 996	198 644 926	4,16
United Kingdom 0.125% 21 - 10.08.31	247 947 044	GBP	282 870 481	290 384 675	6,08
United Kingdom 0.125% 21 - 22.03.51	32 829 749	GBP	30 592 460	30 202 378	0,63
United Kingdom 0.125% 21 - 22.03.39	29 540 328	GBP	31 379 442	31 420 809	0,66
United Kingdom 0.125% 21 - 22.03.73	51 730 683	GBP	48 085 392	47 674 245	1,00
United Kingdom 0.25% 12 - 22.03.52	38 858 854	GBP	37 407 274	36 915 373	0,77
United Kingdom 0.25% 20 - 31.07.31	1 786 000	GBP	1 612 032	1 630 122	0,03
United Kingdom 0.375% 11 - 22.03.62	27 839 518	GBP	27 092 792	26 578 558	0,56
United Kingdom 0.50% 09 - 22.03.50	22 256 259	GBP	23 167 599	22 881 457	0,48
United Kingdom 0.50% 20 - 22.10.61	29 799 000	GBP	11 609 424	11 586 324	0,24
United Kingdom 0.50% 21 - 31.01.29	12 010 000	GBP	11 916 948	12 033 722	0,25
United Kingdom 0.625% 10 - 22.03.40	81 193 803	GBP	90 399 639	92 843 683	1,95
United Kingdom 0.625% 20 - 22.10.50	91 900 000	GBP	46 798 450	46 820 267	0,98
United Kingdom 0.625% 20 - 31.07.35	184 200 000	GBP	145 435 569	151 194 221	3,17
United Kingdom 0.75% 07 - 22.11.47	22 180 001	GBP	24 742 036	24 482 180	0,51
United Kingdom 0.75% 11 - 22.03.34	117 661 205	GBP	138 115 791	142 754 408	2,99
United Kingdom 0.875% 21 - 31.01.46	4 999 000	GBP	3 078 733	3 084 798	0,07
United Kingdom 0.875% 21 - 31.07.33	84 897 000	GBP	75 987 674	76 741 822	1,61
United Kingdom 1.00% 21 - 31.01.32	1 170 000	GBP	1 107 431	1 119 234	0,02
United Kingdom 1.125% 07 - 22.11.37	88 374 704	GBP	107 950 331	110 602 947	2,32
United Kingdom 1.125% 21 - 31.01.39	65 890 000	GBP	49 116 883	51 721 002	1,08
United Kingdom 1.25% 05 - 22.11.55	232 107 112	GBP	276 520 175	289 437 311	6,06
United Kingdom 1.25% 06 - 22.11.27	33 857 668	GBP	41 099 426	41 221 384	0,86
United Kingdom 1.25% 20 - 22.10.41	149 728 000	GBP	109 326 155	112 199 872	2,35
United Kingdom 1.50% 16 - 22.07.47	112 700 000	GBP	77 441 645	78 874 405	1,65
United Kingdom 1.50% 21 - 31.07.53	15 979 000	GBP	10 246 503	10 280 623	0,22
United Kingdom 1.625% 18 - 22.10.71	62 300 000	GBP	37 229 614	37 071 058	0,78

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.625% 19 - 22.10.54	17 999 000	GBP	11 853 363	11 889 128	0,25
United Kingdom 1.75% 16 - 07.09.37	93 795 000	GBP	82 752 004	84 011 151	1,76
United Kingdom 1.75% 17 - 22.07.57	35 077 000	GBP	23 563 270	23 608 698	0,50
United Kingdom 1.75% 18 - 22.01.49	24 529 000	GBP	17 891 336	17 906 290	0,38
United Kingdom 2.00% 02 - 26.01.35	11 049 000	GBP	32 099 818	32 184 878	0,67
United Kingdom 2.50% 15 - 22.07.65	78 181 000	GBP	63 065 419	63 163 483	1,32
United Kingdom 3.25% 12 - 22.01.44	96 620 000	GBP	96 101 681	98 254 799	2,06
United Kingdom 3.50% 13 - 22.07.68	18 479 000	GBP	19 155 885	19 149 928	0,40
United Kingdom 3.50% 14 - 22.01.45	88 889 000	GBP	89 571 133	93 442 713	1,96
United Kingdom 3.75% 23 - 22.10.53	255 850 000	GBP	259 764 825	275 827 660	5,78
United Kingdom 4.00% 09 - 22.01.60	289 846 000	GBP	312 912 367	329 941 964	6,91
United Kingdom 4.125% 92 - 22.07.30	3 999 000	GBP	16 082 056	16 182 520	0,34
United Kingdom 4.25% 03 - 07.03.36	13 278 000	GBP	15 961 980	16 063 937	0,34
United Kingdom 4.25% 05 - 07.12.55	114 246 000	GBP	128 183 057	135 186 883	2,83
United Kingdom 4.25% 08 - 07.12.49	9 999 000	GBP	11 732 484	11 725 967	0,25
United Kingdom 4.25% 09 - 07.09.39	32 789 000	GBP	38 858 092	38 926 247	0,82
United Kingdom 4.25% 10 - 07.12.40	42 821 000	GBP	50 641 700	50 671 913	1,06
United Kingdom 4.50% 09 - 07.09.34	11 999 000	GBP	14 772 513	14 869 409	0,31
United Kingdom 4.75% 04 - 07.12.38	53 809 000	GBP	66 575 876	67 729 429	1,42
			3 709 888 725	3 813 416 305	79,90
Total - Obligations			4 550 412 631	4 646 459 313	97,35
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			4 550 412 631	4 646 459 313	97,35
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			4 550 412 631	4 646 459 313	97,35
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				4 682 831 001	98,11

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
IMMOFINANZ AG 2.50% 20 - 15.10.27	2 000 000	EUR	1 854 831	1 457 640	4,11
Kommunalkredit Austria AG 0.25% 21 - 14.05.24	1 100 000	EUR	1 079 270	1 080 607	3,04
			2 934 101	2 538 247	7,15
Belgique					
Argenta Spaarbank NV 1.00% 20 - 29.01.27	1 200 000	EUR	1 072 229	1 095 828	3,09
			1 072 229	1 095 828	3,09
France					
Capgemini SE 1.125% 20 - 23.06.30	800 000	EUR	666 713	714 840	2,01
Cie de Saint-Gobain 1.125% 18 - 23.03.26	300 000	EUR	283 446	287 505	0,81
Pernod Ricard SA 1.75% 20 - 08.04.30	300 000	EUR	267 712	278 616	0,78
Veolia Environnement SA 1.94% 18 - 07.01.30	1 300 000	EUR	1 170 184	1 216 397	3,43
			2 388 055	2 497 358	7,03
Italie					
A2A SpA 1.50% 22 - 16.03.28	400 000	EUR	373 469	374 780	1,06
Acquirente Unico SpA 2.80% 19 - 20.02.26	750 000	EUR	717 446	734 903	2,07
Intesa Sanpaolo SpA 1.625% 19 - 21.04.25	1 000 000	EUR	973 465	975 860	2,75
Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23 - 19.05.26	600 000	EUR	599 724	608 814	1,71
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.00% 20 - 08.09.27	900 000	EUR	818 564	829 458	2,34
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.375% 17 - 26.07.27	145 000	EUR	133 694	136 680	0,38
UniCredit SpA 0.85% 21 - 19.01.31	417 000	EUR	328 785	343 562	0,97
			3 945 147	4 004 057	11,28
Luxembourg					
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 3.553% 23 - 13.09.29	1 600 000	EUR	1 628 844	1 633 584	4,60
Holcim Finance Luxembourg SA 0.125% 21 - 19.07.27	1 000 000	EUR	876 643	906 950	2,56
Holcim Finance Luxembourg SA 1.50% 22 - 06.04.25	1 000 000	EUR	973 964	973 860	2,74
Traton Finance Luxembourg SA 4.00% 23 - 16.09.25	600 000	EUR	595 132	602 904	1,70
			4 074 583	4 117 298	11,60
Pays-Bas					
Enel Finance International NV 0.375% 19 - 17.06.27	773 000	EUR	695 350	704 628	1,98
Euronext NV 0.125% 21 - 17.05.26	287 000	EUR	261 737	267 039	0,75
Heineken NV 1.375% 16 - 29.01.27	696 000	EUR	651 528	663 149	1,87
JAB Holdings BV 2.50% 18 - 25.06.29	1 500 000	EUR	1 392 739	1 442 175	4,06
Koninklijke KPN NV 0.875% 21 - 15.11.33	1 000 000	EUR	758 284	797 270	2,25
Koninklijke Philips NV 2.125% 22 - 05.11.29	1 000 000	EUR	915 654	920 060	2,59
LYB International Finance II BV 1.625% 19 - 17.09.31	670 000	EUR	564 780	582 129	1,64
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.375% 20 - 22.09.29	2 000 000	EUR	1 718 709	1 726 940	4,86
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.875% 19 - 01.10.31	1 000 000	EUR	824 306	847 930	2,39
PostNL NV 0.625% 19 - 23.09.26	1 300 000	EUR	1 188 130	1 203 813	3,39
Universal Music Group NV 3.00% 22 - 30.06.27	1 000 000	EUR	975 790	1 000 810	2,82
Vesteda Finance BV 1.50% 19 - 24.05.27	470 000	EUR	427 648	443 234	1,25

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Volkswagen International Finance NV 3.875% 23 - 29.03.26	2 000 000	EUR	2 011 281	2 015 180	5,68
Volkswagen International Finance NV 4.125% 22 - 15.11.25	1 000 000	EUR	1 010 638	1 012 570	2,85
			13 396 574	13 626 927	38,38
Norvège					
Sparebank 1 Oestlandet 1.75% 22 - 27.04.27	900 000	EUR	838 336	856 341	2,41
			838 336	856 341	2,41
Espagne					
Abertis Infraestructuras SA 2.25% 20 - 29.03.29	300 000	EUR	271 202	281 817	0,79
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 3.75% 23 - 25.04.30	300 000	EUR	289 829	296 577	0,84
Iberdrola Finanzas SA 1.25% 17 - 13.09.27	600 000	EUR	560 430	572 472	1,61
			1 121 461	1 150 866	3,24
Suède					
Vattenfall AB 3.25% 22 - 18.04.24	1 000 000	EUR	997 697	997 580	2,81
			997 697	997 580	2,81
Royaume-Uni					
British Telecommunications PLC 2.75% 22 - 30.08.27	1 100 000	EUR	1 084 432	1 087 207	3,06
Cadent Finance PLC 0.625% 16 - 22.09.24	450 000	EUR	438 641	439 038	1,24
			1 523 073	1 526 245	4,30
États-Unis					
JPMorgan Chase & Co. 1.75% 15 - 30.01.30	1 500 000	EUR	1 334 539	1 349 325	3,80
Stryker Corp. 1.00% 19 - 03.12.31	1 000 000	EUR	825 390	845 880	2,38
			2 159 929	2 195 205	6,18
Total - Obligations			34 451 185	34 605 952	97,47
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			34 451 185	34 605 952	97,47
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			34 451 185	34 605 952	97,47
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				34 969 796	98,49

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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	1 300 000	USD	1 176 108	1 153 750	0,32
Angola 8.25% 18 - 09.05.28	500 000	USD	454 613	460 000	0,13
Angola 8.25% 18 - 09.05.28	600 000	USD	548 461	552 000	0,15
Angola 8.75% 22 - 14.04.32	1 400 000	USD	1 262 475	1 228 500	0,34
Angola 9.125% 19 - 26.11.49	900 000	USD	784 675	733 500	0,21
Angola 9.375% 18 - 08.05.48	1 150 000	USD	1 031 884	953 062	0,27
Angola 9.375% 18 - 08.05.48	200 000	USD	186 701	165 750	0,05
			5 444 917	5 246 562	1,47
Argentine					
Argentina FRN 20 - 09.07.30	2 200 000	USD	1 026 976	882 750	0,25
Argentina FRN 20 - 09.07.30	2 000 000	USD	989 358	765 000	0,21
Argentina 1.00% 20 - 09.07.29	400 000	USD	132 928	160 000	0,04
Argentina 1.00% 20 - 09.07.29	350 000	USD	105 584	131 687	0,04
Argentina FRN 20 - 09.07.41	1 500 000	USD	584 617	511 875	0,14
Argentina FRN 20 - 09.07.41	200 000	USD	74 247	68 000	0,02
Argentina FRN 20 - 09.07.35	2 800 000	USD	1 062 288	952 000	0,27
Argentina FRN 20 - 09.07.35	2 700 000	USD	1 036 998	918 000	0,26
Argentina FRN 20 - 09.07.46	200 000	USD	58 935	69 250	0,02
Argentina FRN 20 - 09.01.38	1 600 000	USD	658 072	632 000	0,18
Argentina FRN 20 - 09.01.38	1 000 000	USD	420 369	385 000	0,11
			6 150 372	5 475 562	1,54
Azerbaïdjan					
Azerbaijan 3.50% 17 - 01.09.32	750 000	USD	700 198	649 688	0,18
Southern Gas Corridor CJSC 6.875% 16 - 24.03.26	330 000	USD	345 352	334 950	0,09
Southern Gas Corridor CJSC 6.875% 16 - 24.03.26	1 220 000	USD	1 274 933	1 238 300	0,35
			2 320 483	2 222 938	0,62
Bahreïn					
Bahrain 5.25% 21 - 25.01.33	900 000	USD	807 663	801 000	0,22
Bahrain 5.45% 20 - 16.09.32	650 000	USD	587 456	595 563	0,17
Bahrain 5.50% 23 - 01.08.33	600 000	USD	541 290	536 250	0,15
Bahrain 5.625% 19 - 30.09.31	750 000	USD	733 570	704 063	0,20
Bahrain 5.625% 21 - 18.05.34	900 000	USD	811 700	812 250	0,23
Bahrain 6.00% 14 - 19.09.44	900 000	USD	776 641	736 875	0,21
Bahrain 6.75% 17 - 20.09.29	900 000	USD	924 724	913 500	0,26
Bahrain 7.00% 15 - 26.01.26	800 000	USD	813 776	816 000	0,23
Bahrain 7.00% 16 - 12.10.28	1 200 000	USD	1 241 637	1 248 000	0,35
Bahrain 7.375% 20 - 14.05.30	700 000	USD	738 512	728 875	0,20
Bahrain 7.75% 23 - 18.04.35	850 000	USD	863 307	886 125	0,25
CBB International Sukuk Programme Co. WLL 3.875% 21 - 18.05.29	600 000	USD	566 070	543 000	0,15
CBB International Sukuk Programme Co. WLL 3.95% 20 - 16.09.27	850 000	USD	835 561	804 312	0,23
CBB International Sukuk Programme Co. WLL 4.50% 19 - 30.03.27	750 000	USD	732 013	726 562	0,20
CBB International Sukuk Programme Co. WLL 6.25% 23 - 18.10.30	800 000	USD	794 738	808 000	0,23
			11 768 658	11 660 375	3,28

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Bolivie					
Bolivia 4.50% 17 - 20.03.28	800 000	USD	693 130	375 000	0,11
			693 130	375 000	0,11
Brésil					
Brazil 3.75% 21 - 12.09.31	700 000	USD	613 537	625 625	0,18
Brazil 3.875% 20 - 12.06.30	1 550 000	USD	1 433 379	1 418 250	0,40
Brazil 4.50% 19 - 30.05.29	800 000	USD	789 819	772 000	0,22
Brazil 4.625% 17 - 13.01.28	1 150 000	USD	1 135 035	1 139 938	0,32
Brazil 4.75% 19 - 14.01.50	1 550 000	USD	1 311 722	1 195 437	0,34
Brazil 5.00% 14 - 27.01.45	1 400 000	USD	1 194 651	1 142 750	0,32
Brazil 5.625% 09 - 07.01.41	800 000	USD	719 136	743 000	0,21
Brazil 5.625% 16 - 21.02.47	1 200 000	USD	1 119 484	1 054 500	0,30
Brazil 6.00% 16 - 07.04.26	900 000	USD	939 829	924 750	0,26
Brazil 6.00% 23 - 20.10.33	800 000	USD	784 431	801 000	0,22
Brazil 6.25% 23 - 18.03.31	700 000	USD	712 537	726 250	0,20
Brazil 7.125% 06 - 20.01.37	700 000	USD	785 118	765 625	0,21
Brazil 8.25% 04 - 20.01.34	500 000	USD	572 956	590 000	0,16
			12 111 634	11 899 125	3,34
Îles Caïmans					
EDO Sukuk Ltd. 5.875% 23 - 21.09.33	600 000	USD	597 077	618 750	0,17
Gaci First Investment Co. 4.75% 23 - 14.02.30	200 000	USD	199 116	199 962	0,06
Gaci First Investment Co. 4.875% 23 - 14.02.35	300 000	USD	285 983	292 665	0,08
Gaci First Investment Co. 5.00% 22 - 13.10.27	200 000	USD	197 377	201 714	0,06
Gaci First Investment Co. 5.125% 23 - 14.02.53	200 000	USD	180 513	180 980	0,05
Gaci First Investment Co. 5.25% 22 - 13.10.32	200 000	USD	195 982	206 612	0,06
KSA Sukuk Ltd. 2.25% 21 - 17.05.31	400 000	USD	343 980	343 858	0,10
KSA Sukuk Ltd. 2.969% 19 - 29.10.29	400 000	USD	399 490	369 372	0,10
KSA Sukuk Ltd. 3.628% 17 - 20.04.27	500 000	USD	516 826	486 240	0,14
KSA Sukuk Ltd. 4.274% 23 - 22.05.29	400 000	USD	393 305	396 833	0,11
KSA Sukuk Ltd. 4.303% 18 - 19.01.29	300 000	USD	329 215	299 703	0,08
KSA Sukuk Ltd. 4.511% 23 - 22.05.33	400 000	USD	379 069	398 293	0,11
KSA Sukuk Ltd. 5.268% 22 - 25.10.28	400 000	USD	408 686	415 044	0,12
Saudi Electricity Global Sukuk Co. 2 5.06% 13 - 08.04.43	200 000	USD	217 324	191 813	0,05
Saudi Electricity Global Sukuk Co. 3 5.50% 14 - 08.04.44	100 000	USD	121 681	100 848	0,03
			4 765 624	4 702 687	1,32
Chili					
Chile 2.45% 20 - 31.01.31	550 000	USD	524 518	479 516	0,14
Chile 2.55% 20 - 27.01.32	700 000	USD	659 594	601 792	0,17
Chile 2.55% 21 - 27.07.33	1 000 000	USD	875 935	828 984	0,23
Chile 2.75% 22 - 31.01.27	600 000	USD	582 533	567 047	0,16
Chile 3.10% 21 - 22.01.61	800 000	USD	656 496	539 051	0,15
Chile 3.10% 21 - 07.05.41	900 000	USD	799 397	687 210	0,19
Chile 3.24% 18 - 06.02.28	700 000	USD	705 609	667 375	0,19
Chile 3.25% 21 - 21.09.71	400 000	USD	279 756	270 238	0,08
Chile 3.50% 19 - 25.01.50	1 050 000	USD	937 707	801 931	0,23
Chile 3.50% 22 - 31.01.34	700 000	USD	658 485	626 562	0,18
Chile 3.86% 17 - 21.06.47	400 000	USD	373 886	329 228	0,09

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Chile 4.00% 22 - 31.01.52	350 000	USD	292 759	289 822	0,08
Chile 4.34% 22 - 07.03.42	850 000	USD	858 296	763 051	0,21
Chile 4.95% 23 - 05.01.36	700 000	USD	687 471	692 943	0,19
Chile 5.33% 23 - 05.01.54	700 000	USD	659 191	698 228	0,20
Corp Nacional del Cobre de Chile 3.00% 19 - 30.09.29	600 000	USD	545 572	535 500	0,15
Corp Nacional del Cobre de Chile 3.15% 20 - 14.01.30	400 000	USD	388 500	356 500	0,10
Corp Nacional del Cobre de Chile 3.625% 17 - 01.08.27	400 000	USD	412 422	379 356	0,11
Corp Nacional del Cobre de Chile 3.70% 19 - 30.01.50	1 100 000	USD	1 053 212	792 000	0,22
Corp Nacional del Cobre de Chile 4.375% 19 - 05.02.49	500 000	USD	455 115	405 438	0,11
Corp Nacional del Cobre de Chile 4.50% 17 - 01.08.47	600 000	USD	572 948	493 278	0,14
Corp Nacional del Cobre de Chile 5.95% 23 - 08.01.34	600 000	USD	574 888	608 628	0,17
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA 4.70% 20 - 07.05.50	400 000	USD	387 404	332 160	0,09
			13 941 694	12 745 838	3,58
Chine					
China 1.20% 20 - 21.10.30	1 550 000	USD	1 412 622	1 304 908	0,37
China 1.25% 21 - 26.10.26	1 050 000	USD	1 030 081	966 098	0,27
China 1.75% 21 - 26.10.31	850 000	USD	785 222	729 529	0,20
China 2.125% 19 - 03.12.29	1 400 000	USD	1 372 620	1 272 166	0,36
China 2.625% 17 - 02.11.27	800 000	USD	779 464	762 416	0,21
China 3.50% 18 - 19.10.28	700 000	USD	729 243	688 373	0,19
Export-Import Bank of China 2.875% 16 - 26.04.26	650 000	USD	646 067	625 293	0,18
			6 755 319	6 348 783	1,78
Colombie					
Colombia 3.00% 20 - 30.01.30	600 000	USD	509 804	507 086	0,14
Colombia 3.125% 20 - 15.04.31	1 100 000	USD	988 675	896 795	0,25
Colombia 3.25% 21 - 22.04.32	750 000	USD	622 443	599 398	0,17
Colombia 3.875% 17 - 25.04.27	900 000	USD	868 395	859 521	0,24
Colombia 3.875% 21 - 15.02.61	500 000	USD	347 023	313 125	0,09
Colombia 4.125% 20 - 15.05.51	670 000	USD	481 630	450 062	0,13
Colombia 4.125% 21 - 22.02.42	400 000	USD	294 571	287 547	0,08
Colombia 4.50% 15 - 28.01.26	550 000	USD	543 864	540 589	0,15
Colombia 4.50% 18 - 15.03.29	750 000	USD	724 683	703 613	0,20
Colombia 5.00% 15 - 15.06.45	1 900 000	USD	1 617 775	1 478 958	0,42
Colombia 5.20% 19 - 15.05.49	1 250 000	USD	1 159 272	982 189	0,28
Colombia 5.625% 14 - 26.02.44	1 050 000	USD	989 743	884 625	0,25
Colombia 6.125% 09 - 18.01.41	1 000 000	USD	981 640	913 340	0,26
Colombia 7.375% 06 - 18.09.37	700 000	USD	781 894	730 092	0,20
Colombia 7.50% 23 - 02.02.34	1 000 000	USD	947 339	1 059 451	0,30
Colombia 8.00% 22 - 20.04.33	600 000	USD	599 015	657 196	0,18
Colombia 8.00% 23 - 14.11.35	600 000	USD	636 868	658 491	0,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Colombie (suite)					
Colombia 8.75% 23 - 14.11.53	400 000	USD	427 569	463 650	0,13
Empresas Publicas de Medellin ESP 4.25% 19 - 18.07.29	380 000	USD	358 557	324 425	0,09
			13 880 760	13 310 153	3,74
Costa Rica					
Costa Rica 6.125% 19 - 19.02.31	950 000	USD	937 841	972 562	0,27
Costa Rica 6.55% 23 - 03.04.34	1 050 000	USD	1 071 105	1 086 750	0,31
Costa Rica 7.00% 14 - 04.04.44	630 000	USD	592 334	657 563	0,18
Costa Rica 7.158% 15 - 12.03.45	1 050 000	USD	1 001 882	1 113 000	0,31
Costa Rica 7.30% 23 - 13.11.54	1 200 000	USD	1 231 560	1 302 000	0,37
			4 834 722	5 131 875	1,44
République dominicaine					
Dominican Republic 4.50% 20 - 30.01.30	1 200 000	USD	1 098 811	1 102 500	0,31
Dominican Republic 4.875% 20 - 23.09.32	1 850 000	USD	1 715 705	1 681 187	0,47
Dominican Republic 5.30% 21 - 21.01.41	1 000 000	USD	845 574	865 000	0,24
Dominican Republic 5.50% 22 - 22.02.29	1 050 000	USD	993 044	1 026 375	0,29
Dominican Republic 5.875% 20 - 30.01.60	2 100 000	USD	1 805 451	1 811 250	0,51
Dominican Republic 5.95% 17 - 25.01.27	1 000 000	USD	1 005 186	1 002 500	0,28
Dominican Republic 6.00% 18 - 19.07.28	900 000	USD	893 599	900 000	0,25
Dominican Republic 6.00% 22 - 22.02.33	1 100 000	USD	1 020 153	1 082 125	0,30
Dominican Republic 6.40% 19 - 05.06.49	850 000	USD	782 341	805 375	0,23
Dominican Republic 6.50% 18 - 15.02.48	600 000	USD	553 478	570 750	0,16
Dominican Republic 6.85% 15 - 27.01.45	1 300 000	USD	1 282 672	1 293 500	0,36
Dominican Republic 6.875% 16 - 29.01.26	1 100 000	USD	1 140 716	1 117 875	0,32
Dominican Republic 7.45% 14 - 30.04.44	900 000	USD	917 868	952 875	0,27
			14 054 598	14 211 312	3,99
Équateur					
Ecuador FRN 20 - 31.07.40	2 200 000	USD	1 148 001	704 000	0,20
Ecuador FRN 20 - 31.07.35	5 600 000	USD	3 386 545	2 016 000	0,56
Ecuador FRN 20 - 31.07.30	2 600 000	USD	1 944 587	1 202 500	0,34
			6 479 133	3 922 500	1,10
Égypte					
Egypt 5.80% 21 - 30.09.27	800 000	USD	702 338	615 000	0,17
Egypt 5.875% 21 - 16.02.31	1 200 000	USD	889 294	784 500	0,22
Egypt 6.588% 18 - 21.02.28	1 000 000	USD	778 285	765 000	0,22
Egypt 7.053% 19 - 15.01.32	800 000	USD	638 436	546 000	0,15
Egypt 7.30% 21 - 30.09.33	800 000	USD	570 647	527 000	0,15
Egypt 7.50% 17 - 31.01.27	850 000	USD	804 027	712 937	0,20
Egypt 7.50% 17 - 31.01.27	550 000	USD	538 011	461 312	0,13
Egypt 7.50% 21 - 16.02.61	1 200 000	USD	877 925	699 000	0,20
Egypt 7.60% 19 - 01.03.29	1 150 000	USD	963 226	875 437	0,25
Egypt 7.60% 19 - 01.03.29	250 000	USD	239 422	190 313	0,05
Egypt 7.625% 20 - 29.05.32	1 200 000	USD	1 060 679	832 500	0,23
Egypt 7.903% 18 - 21.02.48	1 000 000	USD	906 395	600 000	0,17
Egypt 8.50% 17 - 31.01.47	150 000	USD	107 799	93 188	0,03
Egypt 8.50% 17 - 31.01.47	10 000	USD	5 557	6 213	0,00
Egypt 8.50% 17 - 31.01.47	1 740 000	USD	1 481 695	1 080 975	0,30
Egypt 8.70% 19 - 01.03.49	900 000	USD	720 260	562 500	0,16

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 8.70% 19 - 01.03.49	100 000	USD	65 085	62 500	0,02
Egypt 8.875% 20 - 29.05.50	1 400 000	USD	1 144 802	889 000	0,25
			12 493 883	10 303 375	2,90
Salvador					
El Salvador 7.125% 19 - 20.01.50	850 000	USD	525 138	603 500	0,17
El Salvador 7.65% 05 - 15.06.35	750 000	USD	492 700	583 125	0,16
El Salvador 9.50% 20 - 15.07.52	680 000	USD	612 673	564 400	0,16
			1 630 511	1 751 025	0,49
Ghana					
Ghana 6.375% 20 - 11.02.27	900 000	USD	555 387	400 500	0,11
Ghana 7.625% 18 - 16.05.29	700 000	USD	470 706	302 750	0,09
Ghana 7.75% 21 - 07.04.29	670 000	USD	528 175	291 450	0,08
Ghana 7.875% 20 - 11.02.35	750 000	USD	474 062	327 187	0,09
Ghana 8.125% 19 - 26.03.32	1 100 000	USD	734 242	477 125	0,14
Ghana 8.625% 21 - 07.04.34	650 000	USD	561 498	281 938	0,08
Ghana 8.627% 18 - 16.06.49	100 000	USD	43 062	42 500	0,01
Ghana 8.627% 18 - 16.06.49	600 000	USD	435 010	255 000	0,07
Ghana 8.95% 19 - 26.03.51	800 000	USD	626 322	344 000	0,10
			4 428 464	2 722 450	0,77
Guatemala					
Guatemala 6.125% 19 - 01.06.50	1 050 000	USD	1 180 178	993 563	0,28
Guatemala 6.60% 23 - 13.06.36	700 000	USD	694 815	719 250	0,20
			1 874 993	1 712 813	0,48
Hongrie					
Hungary 2.125% 21 - 22.09.31	1 800 000	USD	1 564 499	1 449 155	0,41
Hungary 3.125% 21 - 21.09.51	1 300 000	USD	1 001 387	879 620	0,25
Hungary 5.25% 22 - 16.06.29	1 350 000	USD	1 320 482	1 355 484	0,38
Hungary 5.50% 22 - 16.06.34	900 000	USD	874 701	913 449	0,25
Hungary 6.125% 23 - 22.05.28	1 500 000	USD	1 554 912	1 559 592	0,44
Hungary 6.25% 23 - 22.09.32	1 100 000	USD	1 137 367	1 172 785	0,33
Hungary 6.75% 23 - 25.09.52	1 000 000	USD	1 056 004	1 117 520	0,31
Hungary 7.625% 11 - 29.03.41	1 310 000	USD	1 606 215	1 562 695	0,44
Magyar Export-Import Bank Zrt 6.125% 23 - 04.12.27	900 000	USD	895 873	915 297	0,26
MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6.50% 23 - 29.06.28	800 000	USD	807 463	822 272	0,23
			11 818 903	11 747 869	3,30
Inde					
Export-Import Bank of India 2.25% 21 - 13.01.31	850 000	USD	768 300	711 147	0,20
Export-Import Bank of India 3.25% 20 - 15.01.30	950 000	USD	867 574	864 895	0,24
Export-Import Bank of India 3.375% 16 - 05.08.26	600 000	USD	601 007	575 904	0,16
Export-Import Bank of India 3.875% 18 - 01.02.28	850 000	USD	837 042	815 974	0,23
Export-Import Bank of India 5.50% 23 - 18.01.33	600 000	USD	608 449	619 435	0,18
			3 682 372	3 587 355	1,01
Indonésie					
Indonesia 1.50% 21 - 09.06.26	200 000	USD	198 774	184 500	0,05
Indonesia 1.85% 21 - 12.03.31	200 000	USD	181 365	166 157	0,05
Indonesia 2.15% 21 - 28.07.31	400 000	USD	323 956	337 238	0,09
Indonesia 2.55% 21 - 09.06.31	200 000	USD	196 566	173 500	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.80% 20 - 23.06.30	300 000	USD	287 326	270 375	0,08
Indonesia 2.85% 20 - 14.02.30	200 000	USD	183 293	180 713	0,05
Indonesia 3.05% 21 - 12.03.51	400 000	USD	320 925	305 152	0,09
Indonesia 3.50% 17 - 11.01.28	200 000	USD	201 504	191 358	0,05
Indonesia 3.55% 22 - 31.03.32	200 000	USD	200 293	184 771	0,05
Indonesia 3.70% 19 - 30.10.49	320 000	USD	325 451	267 148	0,07
Indonesia 3.85% 17 - 18.07.27	200 000	USD	206 144	194 898	0,05
Indonesia 3.85% 20 - 15.10.30	400 000	USD	412 896	380 664	0,11
Indonesia 4.10% 18 - 24.04.28	200 000	USD	200 764	195 812	0,05
Indonesia 4.15% 17 - 29.03.27	550 000	USD	566 235	542 437	0,15
Indonesia 4.20% 20 - 15.10.50	400 000	USD	343 850	358 643	0,10
Indonesia 4.35% 16 - 08.01.27	250 000	USD	246 226	247 933	0,07
Indonesia 4.35% 17 - 11.01.48	450 000	USD	441 347	416 945	0,12
Indonesia 4.40% 18 - 01.03.28	260 000	USD	267 644	258 700	0,07
Indonesia 4.40% 22 - 06.06.27	500 000	USD	489 341	496 875	0,14
Indonesia 4.45% 19 - 20.02.29	200 000	USD	204 264	199 000	0,06
Indonesia 4.45% 20 - 15.04.70	300 000	USD	329 647	270 485	0,08
Indonesia 4.55% 16 - 29.03.26	450 000	USD	459 489	448 875	0,13
Indonesia 4.55% 23 - 11.01.28	300 000	USD	300 856	299 265	0,08
Indonesia 4.625% 13 - 15.04.43	400 000	USD	412 072	391 552	0,11
Indonesia 4.65% 22 - 20.09.32	400 000	USD	373 390	399 480	0,11
Indonesia 4.70% 22 - 06.06.32	400 000	USD	387 424	401 000	0,11
Indonesia 4.75% 15 - 08.01.26	500 000	USD	515 981	498 790	0,14
Indonesia 4.75% 17 - 18.07.47	200 000	USD	199 135	196 822	0,06
Indonesia 4.75% 18 - 11.02.29	300 000	USD	317 165	302 225	0,08
Indonesia 4.85% 23 - 11.01.33	200 000	USD	198 249	203 505	0,06
Indonesia 5.125% 15 - 15.01.45	500 000	USD	558 771	518 047	0,15
Indonesia 5.25% 12 - 17.01.42	480 000	USD	496 385	497 548	0,14
Indonesia 5.25% 16 - 08.01.47	400 000	USD	461 702	417 528	0,12
Indonesia 5.35% 18 - 11.02.49	300 000	USD	335 173	317 894	0,09
Indonesia 5.40% 23 - 15.11.28	240 000	USD	243 143	247 176	0,07
Indonesia 5.60% 23 - 15.11.33	300 000	USD	308 276	317 966	0,09
Indonesia 5.95% 15 - 08.01.46	200 000	USD	245 976	225 256	0,06
Indonesia 6.625% 07 - 17.02.37	300 000	USD	328 292	351 027	0,10
Indonesia 6.75% 14 - 15.01.44	400 000	USD	504 040	490 459	0,14
Indonesia 7.75% 08 - 17.01.38	500 000	USD	661 603	641 165	0,18
Indonesia 8.50% 05 - 12.10.35	400 000	USD	544 925	530 700	0,15
Pertamina Persero PT 1.40% 21 - 09.02.26	300 000	USD	285 481	277 875	0,08
Pertamina Persero PT 4.175% 20 - 21.01.50	300 000	USD	292 446	247 875	0,07
Pertamina Persero PT 5.625% 13 - 20.05.43	300 000	USD	324 816	303 375	0,08
Pertamina Persero PT 6.00% 12 - 03.05.42	300 000	USD	318 102	312 000	0,09
Pertamina Persero PT 6.45% 14 - 30.05.44	300 000	USD	319 356	327 000	0,09
			15 520 059	14 987 709	4,21
Irak					
Iraq 5.80% 06 - 15.01.28	1 181 250	USD	1 069 408	1 102 992	0,31
			1 069 408	1 102 992	0,31

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Vnesheconombank / VEB Finance PLC 6.80% 10 - 22.11.25 ⁽¹⁾	1 200 000	USD	1 317 068	1	0,00
			1 317 068	1	0,00
Côte d'Ivoire					
Ivory Coast 6.125% 17 - 15.06.33	900 000	USD	893 909	826 875	0,23
			893 909	826 875	0,23
Jamaïque					
Jamaica 6.75% 15 - 28.04.28	900 000	USD	933 300	955 125	0,27
Jamaica 7.875% 15 - 28.07.45	1 350 000	USD	1 642 759	1 641 937	0,46
Jamaica 8.00% 07 - 15.03.39	1 000 000	USD	1 247 603	1 246 250	0,35
			3 823 662	3 843 312	1,08
Jordanie					
Jordan 5.75% 16 - 31.01.27	800 000	USD	787 267	785 000	0,22
Jordan 5.85% 20 - 07.07.30	800 000	USD	779 279	743 000	0,21
Jordan 6.125% 15 - 29.01.26	700 000	USD	701 111	698 250	0,20
Jordan 7.375% 17 - 10.10.47	460 000	USD	449 305	408 250	0,11
Jordan 7.375% 17 - 10.10.47	390 000	USD	319 788	346 125	0,10
Jordan 7.50% 23 - 13.01.29	900 000	USD	901 388	910 125	0,25
			3 938 138	3 890 750	1,09
Kazakhstan					
Kazakhstan 4.875% 14 - 14.10.44	600 000	USD	655 287	579 768	0,16
Kazakhstan 6.50% 15 - 21.07.45	1 200 000	USD	1 386 738	1 370 196	0,39
			2 042 025	1 949 964	0,55
Kenya					
Kenya 6.30% 21 - 23.01.34	700 000	USD	601 591	560 875	0,16
Kenya 7.25% 18 - 28.02.28	700 000	USD	624 061	639 625	0,18
Kenya 8.00% 19 - 22.05.32	850 000	USD	827 475	767 125	0,21
Kenya 8.25% 18 - 28.02.48	850 000	USD	708 007	703 375	0,20
			2 761 134	2 671 000	0,75
Koweït					
Kuwait 3.50% 17 - 20.03.27	3 300 000	USD	3 447 045	3 219 744	0,91
			3 447 045	3 219 744	0,91
Malaisie					
Malaysia Sukuk Global Bhd 3.179% 16 - 27.04.26	650 000	USD	656 075	631 521	0,18
			656 075	631 521	0,18
Mexique					
Mexico 2.659% 20 - 24.05.31	300 000	USD	253 597	253 694	0,07
Mexico 3.25% 20 - 16.04.30	300 000	USD	299 411	271 936	0,08
Mexico 3.50% 22 - 12.02.34	500 000	USD	433 566	423 458	0,12
Mexico 3.75% 18 - 11.01.28	300 000	USD	295 494	289 224	0,08
Mexico 3.75% 21 - 19.04.71	400 000	USD	319 833	268 056	0,08
Mexico 3.771% 20 - 24.05.61	400 000	USD	356 113	271 965	0,08
Mexico 4.125% 16 - 21.01.26	200 000	USD	203 733	198 178	0,06
Mexico 4.15% 17 - 28.03.27	300 000	USD	309 255	296 399	0,08
Mexico 4.28% 21 - 14.08.41	400 000	USD	316 409	330 794	0,09

⁽¹⁾ Les obligations russes ont été entièrement dépréciées à la valeur nominale de 0,0001 par devise et par unité au 19 juillet 2022, car leur négociation est exclue des bourses ou les investisseurs occidentaux sont exclus des marchés russes. Cette approche de valorisation est revue lors des réunions régulières du Comité de tarification de DWS.

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.35% 16 - 15.01.47	200 000	USD	168 808	161 456	0,05
Mexico 4.40% 22 - 12.02.52	200 000	USD	171 024	158 844	0,04
Mexico 4.50% 19 - 22.04.29	450 000	USD	450 164	442 602	0,12
Mexico 4.50% 19 - 31.01.50	200 000	USD	189 534	163 753	0,05
Mexico 4.60% 15 - 23.01.46	200 000	USD	189 232	167 243	0,05
Mexico 4.60% 17 - 10.02.48	300 000	USD	285 200	247 919	0,07
Mexico 4.75% 12 - 08.03.44	650 000	USD	570 173	558 801	0,16
Mexico 4.75% 20 - 27.04.32	300 000	USD	301 590	289 193	0,08
Mexico 4.875% 22 - 19.05.33	300 000	USD	288 154	289 500	0,08
Mexico 5.00% 20 - 27.04.51	400 000	USD	427 470	347 708	0,10
Mexico 5.55% 14 - 21.01.45	220 000	USD	210 477	210 398	0,06
Mexico 5.75% 10 - 12.10.10	300 000	USD	304 521	268 872	0,08
Mexico 6.05% 08 - 11.01.40	400 000	USD	458 490	403 636	0,11
Mexico 6.338% 23 - 04.05.53	400 000	USD	407 038	408 272	0,11
Mexico 6.35% 23 - 09.02.35	300 000	USD	317 286	314 452	0,09
Mexico 6.75% 04 - 27.09.34	200 000	USD	229 191	215 019	0,06
Mexico 8.30% 01 - 15.08.31	90 000	USD	109 848	108 876	0,03
Petroleos Mexicanos 4.50% 16 - 23.01.26	200 000	USD	191 533	187 000	0,05
Petroleos Mexicanos 5.35% 18 - 12.02.28	300 000	USD	253 733	259 875	0,07
Petroleos Mexicanos 5.95% 20 - 28.01.31	500 000	USD	447 558	399 375	0,11
Petroleos Mexicanos 6.35% 18 - 12.02.48	200 000	USD	148 330	127 500	0,04
Petroleos Mexicanos 6.375% 14 - 23.01.45	150 000	USD	107 045	97 500	0,03
Petroleos Mexicanos 6.49% 20 - 23.01.27	200 000	USD	201 881	187 500	0,05
Petroleos Mexicanos 6.50% 11 - 02.06.41	200 000	USD	176 174	136 250	0,04
Petroleos Mexicanos 6.50% 18 - 13.03.27	500 000	USD	478 035	466 875	0,13
Petroleos Mexicanos 6.50% 18 - 23.01.29	200 000	USD	166 069	176 500	0,05
Petroleos Mexicanos 6.625% 06 - 15.06.35	300 000	USD	245 128	229 125	0,06
Petroleos Mexicanos 6.70% 22 - 16.02.32	900 000	USD	755 698	744 750	0,21
Petroleos Mexicanos 6.75% 17 - 21.09.47	700 000	USD	567 705	458 500	0,13
Petroleos Mexicanos 6.84% 20 - 23.01.30	300 000	USD	280 242	257 625	0,07
Petroleos Mexicanos 6.875% 17 - 04.08.26	350 000	USD	351 250	339 062	0,10
Petroleos Mexicanos 6.95% 20 - 28.01.60	450 000	USD	359 771	296 437	0,08
Petroleos Mexicanos 7.69% 20 - 23.01.50	1 000 000	USD	855 854	715 000	0,20
Petroleos Mexicanos 10.00% 23 - 07.02.33	300 000	USD	282 031	300 375	0,08
			13 733 648	12 739 497	3,58
Maroc					
Morocco 3.00% 20 - 15.12.32	700 000	USD	615 564	574 875	0,16
Morocco 4.00% 20 - 15.12.50	900 000	USD	800 257	646 875	0,18
Morocco 5.95% 23 - 08.03.28	1 000 000	USD	1 004 621	1 025 000	0,29
Morocco 6.50% 23 - 08.09.33	1 000 000	USD	1 028 565	1 053 750	0,30
			3 449 007	3 300 500	0,93
Pays-Bas					
Petrobras Global Finance BV 5.60% 20 - 03.01.31	500 000	USD	477 315	498 125	0,14
Petrobras Global Finance BV 5.999% 18 - 27.01.28	500 000	USD	509 141	507 500	0,14
Petrobras Global Finance BV 6.50% 23 - 03.07.33	500 000	USD	482 081	506 250	0,14
Petrobras Global Finance BV 6.85% 15 - 05.06.15	700 000	USD	608 982	657 125	0,19
			2 077 519	2 169 000	0,61

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Nigeria 6.125% 21 - 28.09.28	900 000	USD	736 790	796 500	0,22
Nigeria 6.50% 17 - 28.11.27	1 000 000	USD	896 444	912 500	0,26
Nigeria 7.143% 18 - 23.02.30	900 000	USD	806 054	811 125	0,23
Nigeria 7.375% 21 - 28.09.33	1 100 000	USD	960 974	936 375	0,26
Nigeria 7.625% 17 - 28.11.47	1 150 000	USD	958 512	909 938	0,25
Nigeria 7.696% 18 - 23.02.38	900 000	USD	790 860	738 000	0,21
Nigeria 7.875% 17 - 16.02.32	1 330 000	USD	1 223 172	1 195 337	0,33
Nigeria 8.25% 21 - 28.09.51	900 000	USD	810 243	738 000	0,21
Nigeria 8.375% 22 - 24.03.29	1 000 000	USD	901 633	957 500	0,27
Nigeria 8.747% 18 - 21.01.31	700 000	USD	621 359	666 750	0,19
			8 706 041	8 662 025	2,43
Oman					
Oman 4.75% 16 - 15.06.26	1 700 000	USD	1 670 778	1 678 750	0,47
Oman 5.375% 17 - 08.03.27	1 200 000	USD	1 191 930	1 207 500	0,34
Oman 5.625% 18 - 17.01.28	1 489 000	USD	1 462 584	1 515 057	0,43
Oman 5.625% 18 - 17.01.28	161 000	USD	157 434	163 818	0,05
Oman 6.00% 19 - 01.08.29	1 550 000	USD	1 549 051	1 604 250	0,45
Oman 6.25% 21 - 25.01.31	1 250 000	USD	1 278 952	1 312 500	0,37
Oman 6.50% 17 - 08.03.47	1 350 000	USD	1 227 197	1 371 937	0,39
Oman 6.75% 18 - 17.01.48	1 950 000	USD	1 798 227	2 037 750	0,57
Oman 6.75% 20 - 28.10.27	850 000	USD	874 575	896 750	0,25
Oman 7.00% 21 - 25.01.51	800 000	USD	786 987	861 000	0,24
Oman 7.375% 20 - 28.10.32	650 000	USD	704 607	736 938	0,21
Oman Sovereign Sukuk Co. 4.875% 21 - 15.06.30	1 350 000	USD	1 354 175	1 333 125	0,37
			14 056 497	14 719 375	4,14
Pakistan					
Pakistan 6.00% 21 - 08.04.26	1 050 000	USD	878 867	737 625	0,21
Pakistan 6.875% 17 - 05.12.27	1 100 000	USD	871 527	742 500	0,21
Pakistan 7.375% 21 - 08.04.31	1 050 000	USD	893 097	636 563	0,18
Pakistan Global Sukuk Programme Co. Ltd. 7.95% 22 - 31.01.29	680 000	USD	498 262	498 950	0,14
			3 141 753	2 615 638	0,74
Panama					
Banco Nacional de Panama 2.50% 20 - 11.08.30	500 000	USD	438 904	372 500	0,10
Panama 2.252% 20 - 29.09.32	1 200 000	USD	1 074 339	879 000	0,25
Panama 3.16% 19 - 23.01.30	850 000	USD	819 433	724 625	0,20
Panama 3.298% 22 - 19.01.33	600 000	USD	518 130	475 500	0,13
Panama 3.362% 21 - 30.06.31	640 000	USD	621 994	499 200	0,14
Panama 3.75% 19 - 17.04.26	600 000	USD	607 462	570 000	0,16
Panama 3.87% 19 - 23.07.60	1 650 000	USD	1 495 296	987 937	0,28
Panama 3.875% 16 - 17.03.28	650 000	USD	626 910	600 438	0,17
Panama 4.30% 13 - 29.04.53	1 000 000	USD	1 049 657	670 000	0,19
Panama 4.50% 17 - 15.05.47	700 000	USD	647 556	497 875	0,14
Panama 4.50% 18 - 16.04.50	1 300 000	USD	1 232 027	901 875	0,25
Panama 4.50% 20 - 01.04.56	1 250 000	USD	1 276 887	837 500	0,24
Panama 4.50% 22 - 19.01.63	900 000	USD	774 702	592 875	0,17
Panama 6.40% 22 - 14.02.35	1 200 000	USD	1 224 878	1 171 500	0,33
Panama 6.70% 06 - 26.01.36	1 100 000	USD	1 349 052	1 093 125	0,31

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Panama (suite)					
Panama 6.853% 23 - 28.03.54	600 000	USD	587 502	563 250	0,16
Panama 6.875% 23 - 31.01.36	400 000	USD	381 266	399 500	0,11
			14 725 995	11 836 700	3,33
Paraguay					
Paraguay 4.95% 20 - 28.04.31	600 000	USD	629 877	585 750	0,16
Paraguay 5.40% 19 - 30.03.50	1 000 000	USD	971 887	890 000	0,25
Paraguay 6.10% 14 - 11.08.44	750 000	USD	807 945	736 875	0,21
			2 409 709	2 212 625	0,62
Pérou					
Peru 1.862% 20 - 01.12.32	700 000	USD	592 757	549 112	0,15
Peru 2.78% 20 - 01.12.60	1 400 000	USD	1 142 436	877 626	0,25
Peru 2.783% 20 - 23.01.31	2 300 000	USD	2 158 473	2 011 224	0,57
Peru 3.00% 21 - 15.01.34	1 600 000	USD	1 434 464	1 351 158	0,38
Peru 3.23% 20 - 28.07.21	700 000	USD	474 516	438 519	0,12
Peru 3.30% 21 - 11.03.41	800 000	USD	638 879	624 208	0,18
Peru 3.55% 21 - 10.03.51	1 200 000	USD	971 945	916 786	0,26
Peru 3.60% 21 - 15.01.72	600 000	USD	457 682	425 724	0,12
Peru 5.625% 10 - 18.11.50	1 700 000	USD	1 973 824	1 779 757	0,50
Peru 6.55% 07 - 14.03.37	600 000	USD	741 728	670 224	0,19
Peru 8.75% 03 - 21.11.33	1 500 000	USD	2 005 153	1 891 500	0,53
Petroleos del Peru SA 4.75% 17 - 19.06.32	600 000	USD	460 491	435 000	0,12
Petroleos del Peru SA 5.625% 17 - 19.06.47	1 300 000	USD	966 507	799 500	0,22
			14 018 855	12 770 338	3,59
Philippines					
Philippine 1.648% 20 - 10.06.31	650 000	USD	571 281	533 120	0,15
Philippine 2.457% 20 - 05.05.30	550 000	USD	512 532	486 774	0,14
Philippine 2.65% 20 - 10.12.45	800 000	USD	715 281	567 230	0,16
Philippine 2.95% 20 - 05.05.45	700 000	USD	543 775	525 270	0,15
Philippine 3.00% 18 - 01.02.28	1 100 000	USD	1 073 092	1 035 620	0,29
Philippine 3.20% 21 - 06.07.46	1 050 000	USD	948 287	808 530	0,23
Philippine 3.70% 16 - 01.03.41	800 000	USD	752 665	685 397	0,19
Philippine 3.70% 17 - 02.02.42	1 130 000	USD	1 016 393	966 664	0,27
Philippine 3.75% 19 - 14.01.29	700 000	USD	725 019	673 161	0,19
Philippine 3.95% 15 - 20.01.40	1 000 000	USD	960 818	902 420	0,25
Philippine 4.20% 22 - 29.03.47	600 000	USD	611 922	533 160	0,15
Philippine 5.00% 12 - 13.01.37	700 000	USD	743 385	714 969	0,20
Philippine 5.00% 23 - 17.07.33	700 000	USD	713 054	717 970	0,20
Philippine 5.50% 11 - 30.03.26	500 000	USD	535 733	507 815	0,14
Philippine 5.50% 23 - 17.01.48	600 000	USD	623 098	631 828	0,18
Philippine 6.375% 07 - 15.01.32	550 000	USD	631 042	612 980	0,17
Philippine 6.375% 09 - 23.10.34	900 000	USD	1 043 879	1 016 478	0,29
Philippine 7.75% 06 - 14.01.31	800 000	USD	981 978	947 736	0,27
Philippine 9.50% 05 - 02.02.30	1 100 000	USD	1 414 851	1 380 665	0,39
			15 118 085	14 247 787	4,01
Pologne					
Bank Gospodarstwa Krajowego 5.375% 23 - 22.05.33	1 300 000	USD	1 303 378	1 323 504	0,37
Bank Gospodarstwa Krajowego 6.25% 23 - 31.10.28	700 000	USD	727 701	738 759	0,21
Poland 3.25% 16 - 06.04.26	1 200 000	USD	1 196 860	1 161 935	0,33

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Poland 4.875% 23 - 04.10.33	2 000 000	USD	2 011 632	2 022 862	0,57
Poland 5.50% 22 - 16.11.27	1 050 000	USD	1 073 151	1 088 630	0,30
Poland 5.50% 23 - 04.04.53	1 890 000	USD	1 883 937	1 969 671	0,55
Poland 5.75% 22 - 16.11.32	1 150 000	USD	1 200 840	1 239 296	0,35
			9 397 499	9 544 657	2,68
Qatar					
Qatar 3.25% 16 - 02.06.26	1 000 000	USD	1 018 144	971 450	0,27
Qatar 3.75% 20 - 16.04.30	1 000 000	USD	1 053 420	975 599	0,28
Qatar 4.00% 19 - 14.03.29	1 300 000	USD	1 344 395	1 288 473	0,36
Qatar 4.40% 20 - 16.04.50	1 500 000	USD	1 520 889	1 382 920	0,39
Qatar 4.50% 18 - 23.04.28	850 000	USD	919 512	859 321	0,24
Qatar 4.625% 16 - 02.06.46	680 000	USD	797 672	649 006	0,18
Qatar 4.817% 19 - 14.03.49	1 900 000	USD	2 206 685	1 850 036	0,52
Qatar 5.103% 18 - 23.04.48	1 900 000	USD	2 166 244	1 923 560	0,54
Qatar 5.75% 11 - 20.01.42	300 000	USD	402 117	330 135	0,09
Qatar 6.40% 09 - 20.01.40	250 000	USD	344 927	289 635	0,08
Qatar 9.75% 00 - 15.06.30	400 000	USD	513 047	522 064	0,15
QatarEnergy Trading LLC 1.375% 21 - 12.09.26	400 000	USD	379 402	367 265	0,10
QatarEnergy Trading LLC 2.25% 21 - 12.07.31	1 200 000	USD	1 124 678	1 020 741	0,29
QatarEnergy Trading LLC 3.125% 21 - 12.07.41	1 200 000	USD	1 026 160	920 429	0,26
QatarEnergy Trading LLC 3.30% 21 - 12.07.51	1 200 000	USD	1 133 915	875 714	0,25
			15 951 207	14 226 348	4,00
Roumanie					
Romania 3.00% 20 - 14.02.31	1 000 000	USD	917 007	849 190	0,24
Romania 3.00% 22 - 27.02.27	1 000 000	USD	980 368	930 173	0,26
Romania 3.625% 22 - 27.03.32	800 000	USD	722 902	689 387	0,19
Romania 4.00% 20 - 14.02.51	1 460 000	USD	1 276 413	1 052 295	0,30
Romania 5.125% 18 - 15.06.48	900 000	USD	858 269	769 311	0,22
Romania 5.25% 22 - 25.11.27	700 000	USD	656 331	693 980	0,19
Romania 6.00% 22 - 25.05.34	800 000	USD	703 750	802 411	0,23
Romania 6.125% 14 - 22.01.44	750 000	USD	815 032	736 052	0,21
Romania 6.625% 23 - 17.02.28	1 000 000	USD	1 030 923	1 033 999	0,29
Romania 7.125% 23 - 17.01.33	1 200 000	USD	1 256 595	1 292 299	0,36
Romania 7.625% 23 - 17.01.53	950 000	USD	1 029 609	1 061 179	0,30
			10 247 199	9 910 276	2,79
Arabie saoudite					
Saudi Arabia 2.25% 21 - 02.02.33	400 000	USD	359 374	331 122	0,09
Saudi Arabia 2.75% 20 - 03.02.32	200 000	USD	162 943	175 638	0,05
Saudi Arabia 3.25% 16 - 26.10.26	600 000	USD	615 090	578 274	0,16
Saudi Arabia 3.25% 20 - 22.10.30	300 000	USD	297 604	278 145	0,08
Saudi Arabia 3.45% 21 - 02.02.61	300 000	USD	279 411	210 809	0,06
Saudi Arabia 3.625% 17 - 04.03.28	800 000	USD	831 390	773 368	0,22
Saudi Arabia 3.75% 20 - 21.01.55	400 000	USD	368 532	304 024	0,09
Saudi Arabia 4.375% 19 - 16.04.29	600 000	USD	604 276	597 510	0,17
Saudi Arabia 4.50% 16 - 26.10.46	850 000	USD	856 947	752 250	0,21
Saudi Arabia 4.50% 18 - 17.04.30	300 000	USD	299 953	299 903	0,08
Saudi Arabia 4.50% 20 - 22.04.60	500 000	USD	490 611	432 780	0,12
Saudi Arabia 4.625% 17 - 04.10.47	700 000	USD	663 458	627 774	0,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Arabie saoudite (suite)					
Saudi Arabia 4.75% 23 - 18.01.28	500 000	USD	492 369	504 424	0,14
Saudi Arabia 4.875% 23 - 18.07.33	400 000	USD	407 649	407 907	0,11
Saudi Arabia 5.00% 18 - 17.04.49	550 000	USD	590 434	519 321	0,15
Saudi Arabia 5.00% 23 - 18.01.53	500 000	USD	461 635	470 813	0,13
Saudi Arabia 5.25% 19 - 16.01.50	400 000	USD	523 926	391 508	0,11
Saudi Arabia 5.50% 22 - 25.10.32	300 000	USD	303 326	319 311	0,09
Saudi Arabian Oil Co. 2.25% 20 - 24.11.30	400 000	USD	333 886	343 065	0,10
Saudi Arabian Oil Co. 3.25% 20 - 24.11.50	300 000	USD	290 383	212 074	0,06
Saudi Arabian Oil Co. 3.50% 19 - 16.04.29	300 000	USD	300 511	283 767	0,08
Saudi Arabian Oil Co. 3.50% 20 - 24.11.70	200 000	USD	185 148	137 001	0,04
Saudi Arabian Oil Co. 4.25% 19 - 16.04.39	500 000	USD	457 190	445 040	0,12
Saudi Arabian Oil Co. 4.375% 19 - 16.04.49	400 000	USD	427 889	343 304	0,10
			10 603 935	9 739 132	2,74
Sénégal					
Senegal 6.25% 17 - 23.05.33	750 000	USD	672 634	668 438	0,19
Senegal 6.75% 18 - 13.03.48	850 000	USD	751 888	667 250	0,19
			1 424 522	1 335 688	0,38
Serbie					
Serbia 2.125% 20 - 01.12.30	1 050 000	USD	833 650	840 000	0,24
Serbia 6.50% 23 - 26.09.33	600 000	USD	602 398	615 000	0,17
			1 436 048	1 455 000	0,41
Afrique du Sud					
Eskom Holdings SOC Ltd. 6.35% 18 - 10.08.28	750 000	USD	752 383	727 500	0,20
South Africa 4.30% 16 - 12.10.28	1 400 000	USD	1 289 803	1 309 000	0,37
South Africa 4.85% 17 - 27.09.27	700 000	USD	666 987	686 000	0,19
South Africa 4.85% 19 - 30.09.29	1 650 000	USD	1 552 515	1 544 812	0,43
South Africa 4.875% 16 - 14.04.26	850 000	USD	851 839	837 250	0,24
South Africa 5.00% 16 - 12.10.46	600 000	USD	504 278	443 250	0,12
South Africa 5.375% 14 - 24.07.44	800 000	USD	709 114	637 000	0,18
South Africa 5.65% 17 - 27.09.47	1 050 000	USD	939 302	838 688	0,24
South Africa 5.75% 19 - 30.09.49	2 210 000	USD	1 935 122	1 765 237	0,50
South Africa 5.875% 18 - 22.06.30	1 150 000	USD	1 107 502	1 115 500	0,31
South Africa 5.875% 22 - 20.04.32	1 100 000	USD	1 000 837	1 040 875	0,29
South Africa 7.30% 22 - 20.04.52	1 300 000	USD	1 140 434	1 230 125	0,35
			12 450 116	12 175 237	3,42
Sri Lanka					
Sri Lanka 6.20% 17 - 11.05.27	1 150 000	USD	747 561	577 875	0,16
Sri Lanka 6.75% 18 - 18.04.28	900 000	USD	508 489	452 250	0,13
Sri Lanka 6.825% 16 - 18.07.26	950 000	USD	510 841	484 500	0,14
Sri Lanka 7.55% 19 - 28.03.30	1 100 000	USD	728 758	551 375	0,15
Sri Lanka 7.85% 19 - 14.03.29	850 000	USD	508 698	426 063	0,12
			3 004 347	2 492 063	0,70
Trinité-et-Tobago					
Trinidad & Tobago 4.50% 16 - 04.08.26	600 000	USD	589 725	597 000	0,17
			589 725	597 000	0,17
Turquie					
Turkey 4.25% 15 - 14.04.26	400 000	USD	376 219	383 000	0,11
Turkey 4.75% 21 - 26.01.26	500 000	USD	474 655	485 625	0,14

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Turquie (suite)					
Turkey 4.875% 13 - 16.04.43	700 000	USD	514 831	511 000	0,14
Turkey 4.875% 16 - 09.10.26	700 000	USD	657 073	674 625	0,19
Turkey 5.125% 18 - 17.02.28	400 000	USD	354 748	380 500	0,11
Turkey 5.25% 20 - 13.03.30	500 000	USD	448 774	458 125	0,13
Turkey 5.75% 17 - 11.05.47	850 000	USD	669 114	665 125	0,19
Turkey 5.875% 21 - 26.06.31	400 000	USD	339 748	373 000	0,10
Turkey 5.95% 20 - 15.01.31	550 000	USD	485 333	517 687	0,15
Turkey 6.00% 11 - 14.01.41	900 000	USD	691 648	762 750	0,21
Turkey 6.00% 17 - 25.03.27	800 000	USD	765 350	790 000	0,22
Turkey 6.125% 18 - 24.10.28	700 000	USD	661 009	687 750	0,19
Turkey 6.50% 21 - 20.09.33	300 000	USD	259 613	286 500	0,08
Turkey 6.625% 14 - 17.02.45	800 000	USD	678 670	704 000	0,20
Turkey 6.75% 10 - 30.05.40	500 000	USD	435 536	457 500	0,13
Turkey 6.875% 06 - 17.03.36	650 000	USD	586 629	620 750	0,17
Turkey 7.25% 08 - 05.03.38	300 000	USD	256 988	293 250	0,08
Turkey 7.625% 19 - 26.04.29	800 000	USD	780 999	827 000	0,23
Turkey 8.00% 04 - 14.02.34	400 000	USD	402 623	423 000	0,12
Turkey 8.60% 22 - 24.09.27	400 000	USD	403 969	426 500	0,12
Turkey 9.125% 23 - 13.07.30	700 000	USD	698 236	771 750	0,22
Turkey 9.375% 23 - 19.01.33	800 000	USD	792 738	903 000	0,25
Turkey 9.375% 23 - 14.03.29	500 000	USD	511 634	552 500	0,16
Turkey 9.875% 22 - 15.01.28	900 000	USD	930 623	997 875	0,28
Turkey 11.875% 00 - 15.01.30	400 000	USD	474 986	501 500	0,14
			13 651 746	14 454 312	4,06
Ukraine					
Ukraine 6.876% 21 - 21.05.31	1 350 000	USD	901 542	307 125	0,09
Ukraine 7.253% 20 - 15.03.35	2 050 000	USD	1 325 165	476 625	0,13
Ukraine 7.375% 17 - 25.09.34	2 300 000	USD	1 400 240	534 750	0,15
Ukraine 7.75% 15 - 01.09.26	1 000 000	USD	700 735	275 000	0,08
Ukraine 7.75% 15 - 01.09.27	950 000	USD	494 254	261 250	0,07
Ukraine 7.75% 15 - 01.09.28	1 000 000	USD	587 323	275 000	0,08
Ukraine 7.75% 15 - 01.09.29	309 000	USD	97 898	84 975	0,02
Ukraine 7.75% 15 - 01.09.29	691 000	USD	714 864	190 025	0,05
Ukraine 9.75% 18 - 01.11.30	1 050 000	USD	687 372	299 250	0,09
			6 909 393	2 704 000	0,76
Émirats arabes unis					
Abu Dhabi 1.625% 21 - 02.06.28	700 000	USD	646 473	628 775	0,18
Abu Dhabi 1.70% 20 - 02.03.31	500 000	USD	449 737	423 085	0,12
Abu Dhabi 1.875% 21 - 15.09.31	700 000	USD	609 356	592 717	0,17
Abu Dhabi 2.50% 19 - 30.09.29	1 100 000	USD	1 063 871	1 005 653	0,28
Abu Dhabi 2.70% 20 - 02.09.70	500 000	USD	418 994	316 383	0,09
Abu Dhabi 3.00% 21 - 15.09.51	400 000	USD	333 496	286 079	0,08
Abu Dhabi 3.125% 16 - 03.05.26	1 000 000	USD	986 929	968 670	0,27
Abu Dhabi 3.125% 17 - 11.10.27	1 350 000	USD	1 362 090	1 294 164	0,36
Abu Dhabi 3.125% 19 - 30.09.49	1 550 000	USD	1 417 351	1 138 312	0,32
Abu Dhabi 3.125% 20 - 16.04.30	1 000 000	USD	973 866	941 226	0,26
Abu Dhabi 3.875% 20 - 16.04.50	1 300 000	USD	1 360 787	1 090 357	0,31
Abu Dhabi 4.125% 17 - 11.10.47	1 200 000	USD	1 170 886	1 046 196	0,29

Xtrackers II

Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Émirats arabes unis (suite)					
Sharjah 4.00% 20 - 28.07.50	400 000	USD	311 756	266 584	0,08
Sharjah 6.50% 23 - 23.11.32	200 000	USD	199 059	209 803	0,06
United Arab Emirates 2.00% 21 - 19.10.31	200 000	USD	180 770	170 007	0,05
United Arab Emirates 2.875% 21 - 19.10.41	300 000	USD	219 954	227 768	0,06
United Arab Emirates 3.25% 21 - 19.10.61	800 000	USD	660 471	578 212	0,16
United Arab Emirates 4.05% 22 - 07.07.32	700 000	USD	710 475	689 339	0,19
United Arab Emirates 4.917% 23 - 25.09.33	500 000	USD	492 100	525 927	0,15
United Arab Emirates 4.951% 22 - 07.07.52	500 000	USD	487 370	491 826	0,14
			14 055 791	12 891 083	3,62
Uruguay					
Uruguay 4.375% 15 - 27.10.27	1 000 000	USD	1 100 001	1 008 750	0,28
Uruguay 4.375% 19 - 23.01.31	1 500 000	USD	1 653 740	1 486 875	0,42
Uruguay 4.975% 18 - 20.04.55	2 000 000	USD	2 226 070	1 955 000	0,55
Uruguay 5.10% 14 - 18.06.50	2 900 000	USD	3 439 942	2 918 125	0,82
Uruguay 5.75% 22 - 28.10.34	1 600 000	USD	1 646 329	1 734 000	0,49
Uruguay 7.625% 06 - 21.03.36	800 000	USD	1 117 370	994 000	0,28
			11 183 452	10 096 750	2,84
Total - Obligations			376 940 782	349 096 496	98,12
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Dollar Fund-Z-	238	USD	2 640 607	2 654 699	0,75
			2 640 607	2 654 699	0,75
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			2 640 607	2 654 699	0,75
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			379 581 389	351 751 195	98,87
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			379 581 389	351 751 195	98,87
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				357 714 220	100,55

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Region de Bruxelles-Capitale 1.50% 23 - 22.06.70	3 250 000	EUR	1 502 338	1 801 475	10,78
			1 502 338	1 801 475	10,78
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.28	600 000	EUR	525 239	544 152	3,25
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.38	3 385 000	EUR	2 026 736	2 207 866	13,21
			2 551 975	2 752 018	16,46
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 00 - 04.01.31	200 000	EUR	176 102	174 778	1,05
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.125% 22 - 31.03.37	490 000	EUR	376 744	403 010	2,41
			552 846	577 788	3,46
Italie					
Italy Zero Coupon 13 - 01.03.33	1 270 000	EUR	845 683	895 642	5,36
			845 683	895 642	5,36
Luxembourg					
Luxembourg 3.25% 23 - 02.03.43	2 550 000	EUR	2 435 625	2 701 394	16,16
			2 435 625	2 701 394	16,16
Espagne					
Spain Zero Coupon 01 - 30.07.25	440 000	EUR	419 619	420 574	2,52
			419 619	420 574	2,52
Supranationales					
European Union 0.10% 20 - 04.10.40	700 000	EUR	414 458	440 909	2,64
European Union 0.30% 20 - 04.11.50	1 000 000	EUR	462 954	512 260	3,06
European Union 0.70% 21 - 06.07.51	1 100 000	EUR	510 619	626 945	3,75
European Union 2.625% 22 - 04.02.48	220 000	EUR	205 902	204 864	1,23
International Bank for Reconstruction & Development 0.125% 20 - 03.01.51	850 000	EUR	364 833	405 884	2,43
International Development Association 0.70% 22 - 17.01.42	3 955 000	EUR	2 401 904	2 690 270	16,10
International Development Association 2.50% 22 - 15.01.38	1 640 000	EUR	1 439 396	1 568 250	9,38
			5 800 066	6 449 382	38,59
Royaume-Uni					
United Kingdom 1.00% 21 - 31.01.32	400 000	GBP	372 004	382 644	2,29
			372 004	382 644	2,29
Total - Obligations			14 480 156	15 980 917	95,62
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			14 480 156	15 980 917	95,62
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			14 480 156	15 980 917	95,62
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				16 158 380	96,68

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.50% 09 - 25.04.41	380 000	EUR	442 331	463 326	1,84
Ville de Paris 3.50% 23 - 10.07.43	300 000	EUR	272 577	310 266	1,24
			714 908	773 592	3,08
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 04.07.24	260 000	EUR	255 477	255 302	1,01
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 00 - 04.01.31	320 000	EUR	281 763	279 645	1,11
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 05 - 04.01.37	890 000	EUR	628 566	664 224	2,64
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.125% 22 - 31.03.37	500 000	EUR	367 305	411 235	1,64
			1 533 111	1 610 406	6,40
Espagne					
Spain Zero Coupon 13 - 31.10.26	2 195 000	EUR	1 987 681	2 038 672	8,11
			1 987 681	2 038 672	8,11
Supranationales					
European Union 0.10% 20 - 04.10.40	2 160 000	EUR	1 289 239	1 360 520	5,41
European Union 0.30% 20 - 04.11.50	620 000	EUR	289 492	317 601	1,26
International Development Association 2.50% 22 - 15.01.38	300 000	EUR	263 010	286 875	1,14
			1 841 741	1 964 996	7,81
Royaume-Uni					
United Kingdom 0.125% 14 - 22.03.58	649 664	GBP	597 428	570 554	2,27
United Kingdom 0.125% 18 - 10.08.28	4 140 364	GBP	4 713 885	4 837 831	19,24
United Kingdom 0.125% 18 - 10.08.41	4 725 862	GBP	4 613 282	4 903 828	19,50
United Kingdom 0.625% 09 - 22.11.42	2 244 177	GBP	2 564 447	2 517 177	10,01
United Kingdom 1.125% 07 - 22.11.37	3 792 345	GBP	4 532 700	4 746 205	18,87
United Kingdom 1.125% 21 - 31.01.39	610 000	GBP	480 899	478 825	1,90
United Kingdom 1.625% 18 - 22.10.71	500 000	GBP	256 250	297 521	1,18
			17 758 891	18 351 941	72,97
Total - Obligations			23 836 332	24 739 607	98,37
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			23 836 332	24 739 607	98,37
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			23 836 332	24 739 607	98,37
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				24 813 450	98,67

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 2.10% 17 - 20.09.17	15 000 000	EUR	13 329 939	12 844 375	4,95
			13 329 939	12 844 375	4,95
Belgique					
Belgium 144A 3.00% 23 - 22.06.33	21 400 000	EUR	24 363 208	24 410 634	9,41
			24 363 208	24 410 634	9,41
France					
France OAT 144A 2.50% 22 - 25.05.43	60 230 000	EUR	62 308 231	61 883 746	23,87
			62 308 231	61 883 746	23,87
Irlande					
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	27 000 000	EUR	26 634 798	26 630 044	10,27
			26 634 798	26 630 044	10,27
Italie					
Italy 144A 2.80% 16 - 01.03.67	14 520 000	EUR	12 081 079	11 747 986	4,53
Italy 144A 4.00% 05 - 01.02.37	20 000 000	EUR	32 379 033	22 405 619	8,64
			44 460 112	34 153 605	13,17
Portugal					
Portugal Zero Coupon 23 - 19.01.24	10 000 000	EUR	10 995 953	11 031 809	4,26
			10 995 953	11 031 809	4,26
Supranationales					
European Union 0.45% 21 - 04.07.41	10 250 000	EUR	7 464 598	7 430 611	2,87
European Union 2.625% 22 - 04.02.48	36 715 000	EUR	37 976 909	37 766 892	14,56
European Union 3.00% 11 - 04.09.26	15 000 000	EUR	16 747 910	16 828 572	6,49
International Bank for Reconstruction & Development 0.125% 20 - 03.01.51	15 000 000	EUR	8 000 541	7 912 222	3,05
			70 189 958	69 938 297	26,97
Royaume-Uni					
United Kingdom 0.25% 20 - 31.07.31	800 000	GBP	785 915	806 591	0,31
United Kingdom 3.50% 14 - 22.01.45	2 810 000	GBP	3 028 882	3 263 086	1,26
			3 814 797	4 069 677	1,57
Total - Obligations			256 096 996	244 962 187	94,47
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			256 096 996	244 962 187	94,47
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			256 096 996	244 962 187	94,47
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				248 505 870	95,84

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en GBP)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 2.10% 17 - 20.09.17	10 000 000	EUR	6 988 539	6 717 068	10,82
			6 988 539	6 717 068	10,82
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.24	3 080 000	EUR	2 648 751	2 638 615	4,25
Ville de Paris 3.50% 23 - 10.07.43	1 000 000	EUR	788 007	896 181	1,45
			3 436 758	3 534 796	5,70
Allemagne					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.125% 22 - 31.03.37	1 960 000	EUR	1 254 808	1 396 880	2,25
			1 254 808	1 396 880	2,25
Italie					
Italy 144A 2.80% 16 - 01.03.67	7 680 000	EUR	5 025 159	4 874 343	7,85
			5 025 159	4 874 343	7,85
Luxembourg					
Luxembourg 3.25% 23 - 02.03.43	5 000 000	EUR	4 132 639	4 589 871	7,40
			4 132 639	4 589 871	7,40
Portugal					
Portugal Zero Coupon 23 - 19.01.24	10 000 000	EUR	8 647 326	8 653 760	13,94
			8 647 326	8 653 760	13,94
Espagne					
Spain Zero Coupon 07 - 30.07.35	5 525 000	EUR	2 950 192	3 322 956	5,35
			2 950 192	3 322 956	5,35
Supranationales					
European Investment Bank 4.00% 05 - 15.10.37	10 430 000	EUR	9 398 138	10 250 144	16,52
European Union 0.10% 20 - 04.10.40	4 750 000	EUR	2 428 377	2 592 551	4,18
European Union 0.25% 21 - 22.04.36	1 290 000	EUR	755 218	824 114	1,33
European Union 0.30% 20 - 04.11.50	4 200 000	EUR	1 667 228	1 864 329	3,00
European Union 3.00% 11 - 04.09.26	8 000 000	EUR	7 024 397	7 040 509	11,34
International Development Association 2.50% 22 - 15.01.38	1 370 000	EUR	1 041 857	1 135 207	1,83
			22 315 215	23 706 854	38,20
Royaume-Uni					
United Kingdom 0.25% 20 - 31.07.31	3 270 000	GBP	2 529 558	2 586 243	4,17
			2 529 558	2 586 243	4,17
Total - Obligations			57 280 194	59 382 771	95,68
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			57 280 194	59 382 771	95,68
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			57 280 194	59 382 771	95,68
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				59 823 981	96,39

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 - 21.11.25	2 239 000	AUD	1 354 058	1 296 370	0,05
Australia 0.50% 20 - 21.09.26	2 913 000	AUD	1 742 482	1 655 285	0,07
Australia 1.00% 20 - 21.12.30	2 292 000	AUD	1 276 909	1 174 704	0,05
Australia 1.00% 20 - 21.11.31	3 423 000	AUD	1 922 116	1 704 405	0,07
Australia 1.25% 20 - 21.05.32	3 252 000	AUD	1 834 724	1 630 107	0,07
Australia 1.50% 19 - 21.06.31	2 679 000	AUD	1 584 310	1 404 509	0,06
Australia 1.75% 20 - 21.06.51	2 167 000	AUD	945 220	791 149	0,03
Australia 1.75% 21 - 21.11.32	3 209 000	AUD	1 842 285	1 659 733	0,07
Australia 2.25% 16 - 21.05.28	2 205 000	AUD	1 361 153	1 286 368	0,05
Australia 2.50% 18 - 21.05.30	2 603 000	AUD	1 648 000	1 493 457	0,06
Australia 2.75% 15 - 21.06.35	1 591 000	AUD	911 580	868 937	0,04
Australia 2.75% 16 - 21.11.27	2 069 000	AUD	1 306 706	1 238 007	0,05
Australia 2.75% 17 - 21.11.28	1 589 000	AUD	970 890	942 441	0,04
Australia 2.75% 18 - 21.11.29	2 039 000	AUD	1 274 653	1 194 728	0,05
Australia 2.75% 18 - 21.05.41	1 526 000	AUD	889 301	769 536	0,03
Australia 3.00% 16 - 21.03.47	1 589 000	AUD	919 480	793 258	0,03
Australia 3.00% 22 - 21.11.33	2 431 000	AUD	1 461 353	1 383 646	0,06
Australia 3.25% 12 - 21.04.29	2 211 000	AUD	1 432 154	1 337 328	0,05
Australia 3.25% 13 - 21.04.25	2 367 000	AUD	1 486 159	1 450 546	0,06
Australia 3.25% 15 - 21.06.39	1 158 000	AUD	768 018	640 326	0,03
Australia 3.50% 23 - 21.12.34	1 996 000	AUD	1 170 031	1 178 903	0,05
Australia 3.75% 14 - 21.04.37	1 423 000	AUD	1 010 140	848 856	0,03
Australia 3.75% 22 - 21.05.34	2 077 000	AUD	1 315 243	1 257 805	0,05
Australia 4.25% 14 - 21.04.26	2 433 000	AUD	1 582 040	1 522 268	0,06
Australia 4.50% 13 - 21.04.33	2 670 000	AUD	1 922 784	1 718 810	0,07
Australia 4.75% 11 - 21.04.27	2 353 000	AUD	1 553 165	1 504 335	0,06
Australia 4.75% 23 - 21.06.54	1 000 000	AUD	578 745	665 536	0,03
			36 063 699	33 411 353	1,37
Autriche					
Austria 6.25% 97 - 15.07.27	1 027 000	EUR	1 222 843	1 160 828	0,05
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.02.30	1 370 000	EUR	1 290 193	1 182 173	0,05
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.10.40	705 000	EUR	483 533	438 087	0,02
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.02.31	1 667 000	EUR	1 501 031	1 397 613	0,06
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.04.25	908 000	EUR	886 877	875 312	0,04
Austria 144A Zero Coupon 22 - 20.10.28	1 057 000	EUR	956 872	945 328	0,04
Austria 144A 0.25% 21 - 20.10.36	925 000	EUR	761 379	674 510	0,03
Austria 144A 0.50% 17 - 20.04.27	1 802 000	EUR	1 747 465	1 698 385	0,07
Austria 144A 0.50% 19 - 20.02.29	1 645 000	EUR	1 581 443	1 499 746	0,06
Austria 144A 0.70% 21 - 20.04.71	421 000	EUR	226 246	195 302	0,01
Austria 144A 0.75% 16 - 20.10.26	1 534 000	EUR	1 534 444	1 466 519	0,06
Austria 144A 0.75% 18 - 20.02.28	1 429 000	EUR	1 370 782	1 340 831	0,05
Austria 144A 0.75% 20 - 20.03.51	1 048 000	EUR	837 263	633 726	0,03
Austria 144A 0.85% 20 - 30.06.20	472 000	EUR	322 108	219 527	0,01
Austria 144A 0.90% 22 - 20.02.32	1 385 000	EUR	1 260 083	1 215 615	0,05
Austria 144A 1.20% 15 - 20.10.25	1 337 000	EUR	1 352 133	1 305 580	0,05
Austria 144A 1.50% 16 - 20.02.47	1 153 000	EUR	1 090 064	878 355	0,04
Austria 144A 1.50% 16 - 02.11.86	349 000	EUR	269 684	213 797	0,01
Austria 144A 1.85% 22 - 23.05.49	587 000	EUR	478 976	475 881	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 2.00% 22 - 15.07.26	594 000	EUR	585 695	588 298	0,02
Austria 144A 2.10% 17 - 20.09.17	659 000	EUR	859 229	521 994	0,02
Austria 144A 2.40% 13 - 23.05.34	1 065 000	EUR	1 146 305	1 039 440	0,04
Austria 144A 2.90% 23 - 20.02.33	1 808 000	EUR	1 804 727	1 850 126	0,07
Austria 144A 2.90% 23 - 23.05.29	280 000	EUR	281 882	287 952	0,01
Austria 144A 3.15% 12 - 20.06.44	1 011 000	EUR	1 218 054	1 047 194	0,04
Austria 144A 3.15% 23 - 20.10.53	381 000	EUR	365 391	397 345	0,02
Austria 144A 3.45% 23 - 20.10.30	640 000	EUR	655 559	678 010	0,03
Austria 144A 3.80% 12 - 26.01.62	465 000	EUR	721 359	551 165	0,02
Austria 144A 4.15% 07 - 15.03.37	1 563 000	EUR	2 091 736	1 781 320	0,07
Austria 144A 4.85% 09 - 15.03.26	1 196 000	EUR	1 274 218	1 254 604	0,05
			30 177 574	27 814 563	1,14
Belgique					
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	1 059 000	EUR	1 417 912	1 169 983	0,05
Belgium 4.00% 12 - 28.03.32	1 185 000	EUR	1 434 419	1 315 942	0,05
Belgium 5.50% 98 - 28.03.28	2 290 000	EUR	2 657 814	2 587 517	0,11
Belgium 144A Zero Coupon 20 - 22.10.27	1 165 000	EUR	1 106 872	1 071 218	0,04
Belgium 144A Zero Coupon 21 - 22.10.31	1 570 000	EUR	1 412 955	1 297 605	0,05
Belgium 144A 0.10% 20 - 22.06.30	1 465 000	EUR	1 347 745	1 269 422	0,05
Belgium 144A 0.35% 22 - 22.06.32	1 858 000	EUR	1 607 720	1 551 802	0,06
Belgium 144A 0.40% 20 - 22.06.40	975 000	EUR	747 370	649 253	0,03
Belgium 144A 0.65% 21 - 22.06.71	783 000	EUR	451 262	347 965	0,01
Belgium 144A 0.80% 15 - 22.06.25	2 459 000	EUR	2 441 728	2 392 115	0,10
Belgium 144A 0.80% 17 - 22.06.27	1 878 000	EUR	1 867 190	1 787 480	0,07
Belgium 144A 0.80% 18 - 22.06.28	1 781 000	EUR	1 740 297	1 674 176	0,07
Belgium 144A 0.90% 19 - 22.06.29	2 100 000	EUR	2 029 936	1 951 740	0,08
Belgium 144A 1.00% 15 - 22.06.31	2 068 000	EUR	2 000 760	1 866 990	0,08
Belgium 144A 1.00% 16 - 22.06.26	1 773 000	EUR	1 755 738	1 715 377	0,07
Belgium 144A 1.25% 18 - 22.04.33	1 271 000	EUR	1 214 643	1 136 401	0,05
Belgium 144A 1.40% 22 - 22.06.53	1 157 000	EUR	928 934	774 959	0,03
Belgium 144A 1.45% 17 - 22.06.37	743 000	EUR	736 109	626 795	0,03
Belgium 144A 1.60% 16 - 22.06.47	1 287 000	EUR	1 206 649	967 695	0,04
Belgium 144A 1.70% 19 - 22.06.50	1 280 000	EUR	1 058 979	952 858	0,04
Belgium 144A 1.90% 15 - 22.06.38	1 031 000	EUR	1 048 082	908 930	0,04
Belgium 144A 2.15% 16 - 22.06.66	990 000	EUR	1 068 313	779 328	0,03
Belgium 144A 2.25% 17 - 22.06.57	772 000	EUR	816 533	632 191	0,03
Belgium 144A 2.75% 22 - 22.04.39	575 000	EUR	535 863	560 913	0,02
Belgium 144A 3.00% 14 - 22.06.34	1 268 000	EUR	1 357 657	1 304 011	0,05
Belgium 144A 3.00% 23 - 22.06.33	1 918 000	EUR	1 910 625	1 979 376	0,08
Belgium 144A 3.30% 23 - 22.06.54	1 168 000	EUR	1 093 594	1 190 542	0,05
Belgium 144A 3.45% 23 - 22.06.43	566 000	EUR	571 982	596 451	0,03
Belgium 144A 4.25% 10 - 28.03.41	1 857 000	EUR	2 568 482	2 168 047	0,09
Belgium 144A 4.50% 11 - 28.03.26	1 507 000	EUR	1 590 633	1 572 856	0,06
Belgium 144A 5.00% 04 - 28.03.35	2 207 000	EUR	2 978 765	2 683 050	0,11
			44 705 561	41 482 988	1,70
Canada					
Canada 0.25% 20 - 01.03.26	1 745 000	CAD	1 140 548	1 114 430	0,05
Canada 0.50% 20 - 01.09.25	3 385 000	CAD	2 211 172	2 196 823	0,09

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.50% 20 - 01.12.30	3 036 000	CAD	1 845 299	1 752 453	0,07
Canada 1.00% 16 - 01.06.27	954 000	CAD	629 784	607 325	0,02
Canada 1.00% 21 - 01.09.26	1 846 000	CAD	1 244 435	1 188 336	0,05
Canada 1.25% 19 - 01.03.25	743 000	CAD	509 021	492 599	0,02
Canada 1.25% 21 - 01.03.27	1 829 000	CAD	1 211 061	1 175 346	0,05
Canada 1.50% 15 - 01.06.26	1 077 000	CAD	714 837	704 269	0,03
Canada 1.50% 19 - 01.06.30	3 520 000	CAD	2 319 845	2 160 465	0,09
Canada 1.50% 21 - 01.06.31	4 273 000	CAD	2 718 920	2 622 926	0,11
Canada 1.50% 21 - 01.12.31	3 365 000	CAD	2 202 868	2 051 239	0,08
Canada 1.50% 22 - 01.04.25	1 258 000	CAD	872 192	834 486	0,03
Canada 1.75% 21 - 01.12.53	3 402 000	CAD	1 928 062	1 750 267	0,07
Canada 2.00% 17 - 01.06.28	850 000	CAD	578 626	556 506	0,02
Canada 2.00% 17 - 01.12.51	4 579 000	CAD	2 968 158	2 531 888	0,10
Canada 2.00% 22 - 01.06.32	2 614 000	CAD	1 748 308	1 649 094	0,07
Canada 2.25% 14 - 01.06.25	1 114 000	CAD	772 508	745 564	0,03
Canada 2.25% 18 - 01.06.29	506 000	CAD	354 887	333 692	0,01
Canada 2.25% 22 - 01.12.29	568 000	CAD	364 159	373 629	0,02
Canada 2.50% 14 - 01.12.48	1 112 000	CAD	762 768	724 766	0,03
Canada 2.50% 22 - 01.12.32	2 334 000	CAD	1 586 591	1 527 877	0,06
Canada 2.75% 14 - 01.12.64	746 000	CAD	532 030	486 147	0,02
Canada 2.75% 22 - 01.09.27	1 868 000	CAD	1 316 761	1 257 105	0,05
Canada 2.75% 23 - 01.12.55	1 340 000	CAD	830 277	867 491	0,04
Canada 2.75% 23 - 01.06.33	2 118 000	CAD	1 399 250	1 413 452	0,06
Canada 3.00% 22 - 01.10.25	976 000	CAD	717 169	659 450	0,03
Canada 3.00% 23 - 01.04.26	980 000	CAD	664 645	663 095	0,03
Canada 3.25% 23 - 01.09.28	2 092 000	CAD	1 403 346	1 441 242	0,06
Canada 3.25% 23 - 01.12.33	2 301 000	CAD	1 522 941	1 598 814	0,07
Canada 3.50% 11 - 01.12.45	1 180 000	CAD	909 978	864 768	0,04
Canada 3.50% 22 - 01.03.28	1 708 000	CAD	1 205 887	1 184 362	0,05
Canada 3.50% 23 - 01.08.25	1 956 000	CAD	1 328 843	1 331 460	0,05
Canada 3.75% 22 - 01.02.25	1 518 000	CAD	1 051 366	1 034 343	0,04
Canada 3.75% 23 - 01.05.25	1 653 000	CAD	1 125 221	1 127 760	0,05
Canada 4.00% 08 - 01.06.41	874 000	CAD	693 138	670 787	0,03
Canada 4.00% 23 - 01.03.29	1 417 000	CAD	988 825	983 150	0,04
Canada 4.50% 23 - 01.11.25	2 109 000	CAD	1 438 279	1 463 277	0,06
Canada 4.50% 23 - 01.02.26	2 980 000	CAD	2 049 227	2 077 644	0,08
Canada 5.00% 04 - 01.06.37	712 000	CAD	599 867	589 146	0,02
Canada 5.75% 98 - 01.06.29	1 037 000	CAD	829 626	805 477	0,03
Canada 5.75% 01 - 01.06.33	1 001 000	CAD	867 821	832 582	0,03
			50 158 546	48 445 532	1,98
Danemark					
Denmark Zero Coupon 21 - 15.11.31	6 935 000	DKK	898 143	786 999	0,03
Denmark 0.25% 20 - 15.11.52	6 570 000	DKK	745 334	500 645	0,02
Denmark 0.50% 17 - 15.11.27	7 174 000	DKK	951 987	906 065	0,04
Denmark 0.50% 19 - 15.11.29	7 050 000	DKK	922 093	863 753	0,04
Denmark 1.75% 14 - 15.11.25	7 043 000	DKK	947 888	932 508	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Danemark (suite)					
Denmark 2.25% 23 - 15.11.33	3 896 000	DKK	501 135	521 112	0,02
Denmark 4.50% 08 - 15.11.39	11 751 000	DKK	2 312 936	2 010 649	0,08
			7 279 516	6 521 731	0,27
Finlande					
Finland 144A Zero Coupon 20 - 15.09.30	760 000	EUR	663 102	648 029	0,03
Finland 144A Zero Coupon 21 - 15.09.26	399 000	EUR	395 208	374 110	0,01
Finland 144A 0.125% 20 - 15.04.36	588 000	EUR	488 782	429 058	0,02
Finland 144A 0.125% 21 - 15.04.52	555 000	EUR	369 187	272 583	0,01
Finland 144A 0.125% 21 - 15.09.31	691 000	EUR	662 352	578 028	0,02
Finland 144A 0.25% 20 - 15.09.40	438 000	EUR	332 225	289 982	0,01
Finland 144A 0.50% 16 - 15.04.26	700 000	EUR	695 487	669 802	0,03
Finland 144A 0.50% 17 - 15.09.27	690 000	EUR	702 403	647 172	0,03
Finland 144A 0.50% 18 - 15.09.28	612 000	EUR	589 594	562 159	0,02
Finland 144A 0.50% 19 - 15.09.29	732 000	EUR	702 282	661 098	0,03
Finland 144A 0.50% 22 - 15.04.43	499 000	EUR	378 692	325 882	0,01
Finland 144A 0.75% 15 - 15.04.31	664 000	EUR	632 792	590 582	0,02
Finland 144A 0.875% 15 - 15.09.25	714 000	EUR	708 955	693 694	0,03
Finland 144A 1.125% 18 - 15.04.34	454 000	EUR	456 593	393 913	0,02
Finland 144A 1.375% 17 - 15.04.47	745 000	EUR	703 899	564 561	0,02
Finland 144A 1.375% 22 - 15.04.27	641 000	EUR	619 687	621 206	0,03
Finland 144A 1.50% 22 - 15.09.32	550 000	EUR	514 334	506 380	0,02
Finland 144A 2.625% 12 - 04.07.42	555 000	EUR	710 690	539 210	0,02
Finland 144A 2.75% 12 - 04.07.28	688 000	EUR	741 364	700 976	0,03
Finland 144A 2.75% 23 - 15.04.38	447 000	EUR	425 251	444 586	0,02
Finland 144A 2.875% 23 - 15.04.29	400 000	EUR	399 868	410 440	0,02
Finland 144A 3.00% 23 - 15.09.33	679 000	EUR	674 715	702 724	0,03
Finland 144A 4.00% 09 - 04.07.25	570 000	EUR	603 031	580 100	0,02
			13 170 493	12 206 275	0,50
France					
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	5 101 000	EUR	5 030 642	4 926 546	0,20
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	5 400 000	EUR	5 084 093	4 734 720	0,19
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	4 984 000	EUR	4 869 317	4 738 787	0,19
France OAT Zero Coupon 20 - 25.11.30	6 522 000	EUR	5 941 705	5 573 701	0,23
France OAT Zero Coupon 21 - 25.11.31	5 921 000	EUR	5 290 374	4 913 838	0,20
France OAT Zero Coupon 21 - 25.02.27	4 660 000	EUR	4 472 758	4 343 586	0,18
France OAT Zero Coupon 22 - 25.05.32	4 133 000	EUR	3 556 739	3 377 901	0,14
France OAT Zero Coupon 22 - 25.02.25	3 555 000	EUR	3 486 196	3 439 463	0,14
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	4 184 000	EUR	4 077 093	3 950 114	0,16
France OAT 0.50% 15 - 25.05.25	4 877 000	EUR	4 821 224	4 732 153	0,19
France OAT 0.50% 16 - 25.05.26	5 946 000	EUR	5 813 568	5 691 511	0,23
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	6 231 000	EUR	5 915 471	5 685 788	0,23
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	6 991 000	EUR	6 833 099	6 563 151	0,27
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	6 569 000	EUR	6 431 364	6 122 965	0,25
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	3 849 000	EUR	3 032 492	2 204 707	0,09
France OAT 0.75% 22 - 25.02.28	5 579 000	EUR	5 223 943	5 254 860	0,22
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	4 213 000	EUR	4 198 480	4 099 670	0,17
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	4 569 000	EUR	4 544 238	4 383 956	0,18
France OAT 1.25% 18 - 25.05.34	4 927 000	EUR	4 647 754	4 325 413	0,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.25% 22 - 25.05.38	1 858 000	EUR	1 459 383	1 511 111	0,06
France OAT 1.50% 15 - 25.05.31	6 831 000	EUR	6 818 699	6 445 049	0,26
France OAT 2.00% 22 - 25.11.32	5 082 000	EUR	4 790 565	4 889 900	0,20
France OAT 2.50% 14 - 25.05.30	6 943 000	EUR	7 278 957	7 027 705	0,29
France OAT 2.50% 23 - 24.09.26	5 300 000	EUR	5 245 977	5 320 140	0,22
France OAT 2.75% 12 - 25.10.27	6 463 066	EUR	6 839 843	6 580 048	0,27
France OAT 2.75% 23 - 25.02.29	3 732 000	EUR	3 713 557	3 820 075	0,16
France OAT 3.00% 23 - 25.05.33	4 296 000	EUR	4 316 343	4 466 122	0,18
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	3 391 000	EUR	4 222 567	3 537 152	0,14
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	4 907 000	EUR	5 164 231	5 028 203	0,21
France OAT 3.50% 23 - 25.11.33	1 569 000	EUR	1 608 012	1 695 618	0,07
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	3 019 000	EUR	3 838 658	3 450 113	0,14
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	2 252 000	EUR	3 297 116	2 692 716	0,11
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	4 228 000	EUR	5 874 465	5 153 509	0,21
France OAT 4.75% 04 - 25.04.35	3 351 000	EUR	4 425 031	4 029 913	0,16
France OAT 5.50% 98 - 25.04.29	4 419 000	EUR	5 319 549	5 117 202	0,21
France OAT 5.75% 01 - 25.10.32	4 006 000	EUR	5 353 716	5 029 533	0,21
France OAT 6.00% 94 - 25.10.25	3 464 000	EUR	3 753 237	3 674 265	0,15
France OAT 144A 0.50% 20 - 25.05.40	2 853 000	EUR	2 446 311	1 974 561	0,08
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.05.72	1 431 000	EUR	820 150	594 008	0,02
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.06.44	2 596 000	EUR	1 758 842	1 625 615	0,07
France OAT 144A 0.75% 21 - 25.05.53	3 426 000	EUR	2 346 057	1 922 329	0,08
France OAT 144A 1.25% 16 - 25.05.36	5 109 000	EUR	4 778 748	4 319 149	0,18
France OAT 144A 1.50% 19 - 25.05.50	3 715 000	EUR	3 353 274	2 697 833	0,11
France OAT 144A 1.75% 16 - 25.05.66	1 977 000	EUR	1 738 121	1 408 613	0,06
France OAT 144A 1.75% 17 - 25.06.39	3 757 000	EUR	3 584 925	3 264 457	0,13
France OAT 144A 2.00% 17 - 25.05.48	3 417 000	EUR	3 438 639	2 825 517	0,12
France OAT 144A 2.50% 22 - 25.05.43	1 504 000	EUR	1 314 646	1 398 720	0,06
France OAT 144A 3.00% 23 - 25.05.54	2 447 000	EUR	2 235 985	2 401 241	0,10
France OAT 144A 4.00% 05 - 25.04.55	2 177 000	EUR	2 998 811	2 568 642	0,11
			207 404 965	195 531 889	8,01
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	3 440 000	EUR	3 359 721	3 255 203	0,13
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	3 508 000	EUR	3 351 717	3 159 129	0,13
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	4 328 000	EUR	3 028 121	2 411 042	0,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	3 110 000	EUR	2 948 748	2 769 921	0,11
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	2 617 000	EUR	2 591 966	2 528 153	0,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	2 630 000	EUR	2 238 653	2 069 941	0,08
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	2 442 000	EUR	2 321 212	2 263 832	0,09
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	3 832 000	EUR	3 501 813	3 384 844	0,14

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 20 - 10.10.25	3 030 000	EUR	2 974 260	2 904 679	0,12
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	926 000	EUR	859 638	816 704	0,03
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	1 151 000	EUR	1 123 242	1 105 087	0,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.02.31	2 977 000	EUR	2 769 629	2 601 928	0,11
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	3 274 000	EUR	3 189 900	3 114 229	0,13
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.05.36	2 854 000	EUR	2 436 230	2 186 649	0,09
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.11.28	2 871 000	EUR	2 818 620	2 618 754	0,11
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	1 183 000	EUR	800 162	661 959	0,03
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	3 562 000	EUR	3 274 371	3 080 738	0,13
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	2 537 000	EUR	2 478 810	2 392 645	0,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	3 266 000	EUR	2 036 857	1 740 549	0,07
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	932 000	EUR	831 380	805 341	0,03
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.02.32	3 500 000	EUR	3 133 413	2 991 765	0,12
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 16.04.27	2 264 000	EUR	2 156 361	2 119 489	0,09
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.10.27	3 308 000	EUR	3 239 480	3 228 410	0,13
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	3 224 000	EUR	3 245 631	3 050 774	0,12
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	3 272 000	EUR	3 177 327	3 035 729	0,12
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	3 236 000	EUR	3 167 212	2 980 291	0,12
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	3 407 000	EUR	3 392 559	3 318 214	0,14
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	3 587 000	EUR	3 548 826	3 454 998	0,14
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	3 617 000	EUR	3 548 372	3 432 135	0,14
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	3 237 000	EUR	3 183 188	3 055 825	0,13
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	3 592 000	EUR	3 589 519	3 505 181	0,14
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 22 - 15.05.38	2 330 000	EUR	1 963 034	1 979 568	0,08
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	4 104 000	EUR	3 995 524	3 333 720	0,14
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	1 082 000	EUR	1 045 019	1 057 612	0,04
Bundesrepublik Deutschland 1.70% 22 - 15.08.32	3 088 000	EUR	3 013 379	3 020 960	0,12
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 22 - 15.08.53	2 919 000	EUR	2 498 936	2 632 033	0,11
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	643 000	EUR	556 061	581 092	0,02
Bundesrepublik Deutschland 2.10% 22 - 15.11.29	2 950 000	EUR	2 916 273	2 977 641	0,12
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 23 - 13.04.28	3 032 000	EUR	3 015 824	3 059 500	0,13
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	4 324 000	EUR	4 303 830	4 430 414	0,18
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	799 000	EUR	793 501	818 256	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.40% 23 - 19.10.28	3 231 000	EUR	3 214 306	3 296 557	0,14
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 15.11.30	1 438 000	EUR	1 435 221	1 479 558	0,06
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 04.07.44	3 443 000	EUR	4 020 724	3 556 998	0,15
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	3 527 000	EUR	4 424 530	3 662 684	0,15
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	1 858 000	EUR	1 848 487	1 850 624	0,08
Bundesrepublik Deutschland 2.60% 23 - 15.08.33	3 229 000	EUR	3 262 484	3 387 189	0,14
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	1 880 000	EUR	1 876 917	1 883 403	0,08
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	1 792 000	EUR	1 794 738	1 809 293	0,07
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	1 300 000	EUR	1 307 447	1 316 887	0,05
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 04.07.42	2 231 000	EUR	2 967 738	2 547 869	0,10
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 04.01.37	3 183 000	EUR	4 225 285	3 827 303	0,16
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 04.07.39	2 153 000	EUR	3 009 543	2 708 840	0,11
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 04.07.28	1 459 000	EUR	1 707 037	1 628 390	0,07
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 04.07.34	2 653 000	EUR	3 689 003	3 316 064	0,14
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	1 939 000	EUR	3 042 065	2 593 762	0,11
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	488 000	EUR	631 021	652 788	0,03
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 04.01.31	2 471 000	EUR	3 308 403	3 035 376	0,12
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 04.01.28	1 790 000	EUR	2 137 226	2 035 105	0,08
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 04.01.30	1 303 000	EUR	1 676 736	1 615 134	0,07
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 04.07.27	1 705 000	EUR	2 008 945	1 955 072	0,08
			160 006 175	152 093 830	6,23
Irlande					
Ireland Zero Coupon 21 - 18.10.31	1 039 000	EUR	945 798	868 396	0,04
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	828 000	EUR	814 830	774 263	0,03
Ireland 0.20% 20 - 18.10.30	918 000	EUR	842 286	797 742	0,03
Ireland 0.35% 22 - 18.10.32	533 000	EUR	501 684	447 507	0,02
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	610 000	EUR	527 882	482 388	0,02
Ireland 0.55% 21 - 22.04.41	450 000	EUR	321 272	313 560	0,01
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	993 000	EUR	970 779	938 782	0,04
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	1 309 000	EUR	1 312 937	1 269 206	0,05
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	1 227 000	EUR	1 215 058	1 157 184	0,05
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	640 000	EUR	617 375	579 648	0,02
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	705 000	EUR	703 936	661 502	0,03
Ireland 1.50% 19 - 15.05.50	1 034 000	EUR	909 983	774 673	0,03
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	865 000	EUR	931 929	769 850	0,03
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	1 290 000	EUR	1 298 661	1 109 916	0,05
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	985 000	EUR	1 049 664	992 782	0,04
Ireland 3.00% 23 - 18.10.43	347 000	EUR	347 111	358 763	0,01
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	1 194 000	EUR	1 249 946	1 225 760	0,05
			14 561 131	13 521 922	0,55
Israël					
Israel 0.50% 20 - 30.04.25	2 349 000	ILS	584 877	565 312	0,02
Israel 0.50% 21 - 27.02.26	2 549 000	ILS	633 168	598 426	0,02
Israel 1.00% 19 - 31.03.30	4 332 000	ILS	1 001 436	922 597	0,04
Israel 1.30% 21 - 30.04.32	2 730 000	ILS	598 005	559 132	0,02
Israel 1.50% 20 - 31.05.37	3 161 000	ILS	660 192	570 757	0,02
Israel 1.75% 15 - 31.08.25	2 483 000	ILS	661 211	603 996	0,02
Israel 2.00% 16 - 31.03.27	3 027 000	ILS	762 600	723 086	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Israël (suite)					
Israel 2.25% 18 - 28.09.28	2 848 000	ILS	717 311	672 920	0,03
Israel 2.80% 22 - 29.11.52	1 197 000	ILS	230 306	215 057	0,01
Israel 3.75% 17 - 31.03.47	2 943 000	ILS	926 113	655 564	0,03
Israel 3.75% 23 - 28.02.29	1 061 000	ILS	255 857	267 243	0,01
Israel 5.50% 12 - 31.01.42	2 215 000	ILS	809 351	632 650	0,03
Israel 6.25% 06 - 30.10.26	1 709 000	ILS	514 467	458 457	0,02
			8 354 894	7 445 197	0,30
Italie					
Italy Zero Coupon 21 - 01.04.26	2 230 000	EUR	2 141 041	2 093 064	0,09
Italy Zero Coupon 21 - 01.08.26	2 240 000	EUR	2 152 700	2 085 252	0,09
Italy 0.25% 21 - 15.03.28	2 030 000	EUR	1 943 040	1 818 030	0,07
Italy 0.35% 19 - 01.02.25	1 863 000	EUR	1 833 135	1 805 515	0,07
Italy 0.45% 21 - 15.02.29	1 820 000	EUR	1 646 157	1 598 243	0,07
Italy 0.50% 20 - 01.02.26	2 199 000	EUR	2 148 611	2 094 242	0,09
Italy 0.50% 21 - 15.07.28	1 923 000	EUR	1 795 306	1 725 071	0,07
Italy 0.85% 19 - 15.01.27	2 347 000	EUR	2 266 830	2 214 889	0,09
Italy 0.90% 20 - 01.04.31	2 706 000	EUR	2 429 976	2 286 382	0,09
Italy 0.95% 20 - 01.08.30	2 447 000	EUR	2 243 200	2 113 980	0,09
Italy 0.95% 20 - 15.09.27	2 378 000	EUR	2 288 918	2 220 745	0,09
Italy 0.95% 21 - 01.06.32	2 475 000	EUR	2 154 235	2 024 860	0,08
Italy 1.10% 22 - 01.04.27	1 651 000	EUR	1 563 113	1 564 355	0,06
Italy 1.20% 22 - 15.08.25	1 721 000	EUR	1 683 292	1 673 052	0,07
Italy 1.25% 16 - 01.12.26	2 154 000	EUR	2 128 238	2 062 230	0,08
Italy 1.35% 19 - 01.04.30	2 434 000	EUR	2 308 593	2 180 309	0,09
Italy 1.45% 18 - 15.05.25	1 890 000	EUR	1 878 475	1 849 032	0,08
Italy 1.50% 15 - 01.06.25	2 417 000	EUR	2 396 210	2 364 501	0,10
Italy 1.60% 16 - 01.06.26	2 741 000	EUR	2 711 109	2 664 563	0,11
Italy 2.00% 15 - 01.12.25	2 022 000	EUR	2 018 325	1 989 033	0,08
Italy 2.00% 18 - 01.02.28	2 714 000	EUR	2 672 276	2 622 454	0,11
Italy 2.05% 17 - 01.08.27	2 045 000	EUR	2 045 828	1 990 660	0,08
Italy 2.10% 19 - 15.07.26	1 938 000	EUR	1 937 945	1 904 872	0,08
Italy 2.20% 17 - 01.06.27	2 142 000	EUR	2 108 994	2 099 282	0,09
Italy 2.50% 18 - 15.11.25	2 389 000	EUR	2 384 551	2 371 636	0,10
Italy 2.50% 22 - 01.12.32	1 991 000	EUR	1 784 549	1 836 966	0,07
Italy 2.65% 22 - 01.12.27	1 826 000	EUR	1 777 347	1 810 951	0,07
Italy 2.80% 18 - 01.12.28	2 384 000	EUR	2 446 976	2 364 252	0,10
Italy 2.80% 22 - 15.06.29	1 701 000	EUR	1 658 764	1 675 506	0,07
Italy 3.00% 19 - 01.08.29	2 533 000	EUR	2 564 198	2 521 401	0,10
Italy 3.40% 22 - 01.04.28	2 035 000	EUR	2 011 439	2 072 121	0,08
Italy 3.40% 23 - 28.03.25	1 915 000	EUR	1 911 962	1 920 440	0,08
Italy 3.50% 22 - 15.01.26	1 802 000	EUR	1 803 351	1 824 671	0,07
Italy 3.60% 23 - 29.09.25	1 397 000	EUR	1 395 065	1 411 491	0,06
Italy 3.70% 23 - 15.06.30	2 086 000	EUR	2 081 501	2 139 087	0,09
Italy 3.80% 23 - 15.04.26	2 160 000	EUR	2 184 419	2 206 220	0,09
Italy 3.80% 23 - 01.08.28	1 939 000	EUR	1 948 994	2 005 046	0,08
Italy 3.85% 22 - 15.12.29	2 046 000	EUR	2 033 792	2 119 034	0,09
Italy 3.85% 23 - 15.09.26	1 852 000	EUR	1 867 935	1 901 160	0,08
Italy 4.00% 23 - 15.11.30	1 740 000	EUR	1 763 230	1 814 828	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.10% 23 - 01.02.29	1 640 000	EUR	1 684 230	1 719 203	0,07
Italy 4.20% 23 - 01.03.34	2 020 000	EUR	2 026 830	2 112 129	0,09
Italy 4.35% 23 - 01.11.33	2 255 000	EUR	2 311 528	2 386 661	0,10
Italy 4.40% 22 - 01.05.33	2 522 000	EUR	2 568 390	2 685 901	0,11
Italy 5.25% 98 - 01.11.29	3 341 000	EUR	3 810 279	3 717 689	0,15
Italy 5.75% 02 - 01.02.33	2 916 000	EUR	3 481 339	3 401 684	0,14
Italy 6.00% 00 - 01.05.31	3 461 000	EUR	4 128 057	4 066 745	0,17
Italy 6.50% 97 - 01.11.27	3 010 000	EUR	3 471 370	3 401 447	0,14
Italy 7.25% 97 - 01.11.26	1 208 000	EUR	1 350 630	1 352 429	0,06
Italy 144A 0.60% 21 - 01.08.31	2 521 000	EUR	2 182 868	2 058 185	0,08
Italy 144A 0.95% 21 - 01.03.37	1 878 000	EUR	1 606 729	1 313 839	0,05
Italy 144A 0.95% 21 - 01.12.31	2 386 000	EUR	2 126 161	1 982 947	0,08
Italy 144A 1.45% 20 - 01.03.36	1 457 000	EUR	1 379 008	1 119 740	0,05
Italy 144A 1.50% 21 - 30.04.45	1 404 000	EUR	997 972	886 616	0,04
Italy 144A 1.65% 15 - 01.03.32	2 682 000	EUR	2 442 040	2 343 029	0,10
Italy 144A 1.65% 20 - 01.12.30	2 370 000	EUR	2 320 738	2 128 337	0,09
Italy 144A 1.70% 20 - 01.09.51	1 674 000	EUR	1 331 647	1 025 068	0,04
Italy 144A 1.80% 20 - 01.03.41	1 554 000	EUR	1 386 747	1 119 260	0,05
Italy 144A 1.85% 20 - 01.07.25	1 859 000	EUR	1 867 921	1 825 485	0,07
Italy 144A 2.15% 21 - 01.03.72	531 000	EUR	381 268	321 906	0,01
Italy 144A 2.15% 22 - 01.09.52	1 189 000	EUR	980 976	790 303	0,03
Italy 144A 2.25% 16 - 01.09.36	1 819 000	EUR	1 746 274	1 522 670	0,06
Italy 144A 2.45% 17 - 01.09.33	2 048 000	EUR	2 030 986	1 856 939	0,08
Italy 144A 2.45% 20 - 01.09.50	1 573 000	EUR	1 418 967	1 148 537	0,05
Italy 144A 2.70% 16 - 01.03.47	2 135 000	EUR	2 033 606	1 679 615	0,07
Italy 144A 2.80% 16 - 01.03.67	1 145 000	EUR	1 002 147	834 195	0,03
Italy 144A 2.95% 18 - 01.09.38	1 605 000	EUR	1 608 339	1 420 515	0,06
Italy 144A 3.10% 19 - 01.03.40	1 690 000	EUR	1 627 265	1 494 774	0,06
Italy 144A 3.25% 15 - 01.09.46	2 094 000	EUR	2 038 193	1 811 412	0,07
Italy 144A 3.25% 22 - 01.03.38	1 469 000	EUR	1 301 130	1 347 744	0,05
Italy 144A 3.35% 19 - 01.03.35	1 863 000	EUR	1 828 842	1 789 512	0,07
Italy 144A 3.45% 17 - 01.03.48	1 965 000	EUR	2 025 858	1 752 343	0,07
Italy 144A 3.50% 14 - 01.03.30	3 010 000	EUR	3 172 350	3 064 267	0,13
Italy 144A 3.85% 19 - 01.09.49	1 815 000	EUR	1 883 903	1 711 564	0,07
Italy 144A 4.00% 05 - 01.02.37	3 653 000	EUR	3 954 125	3 693 518	0,15
Italy 144A 4.00% 22 - 30.04.35	1 258 000	EUR	1 216 620	1 283 254	0,05
Italy 144A 4.00% 23 - 30.10.31	1 003 000	EUR	1 005 109	1 044 520	0,04
Italy 144A 4.45% 23 - 01.09.43	1 109 000	EUR	1 097 122	1 142 934	0,05
Italy 144A 4.50% 10 - 01.03.26	2 544 000	EUR	2 684 393	2 630 353	0,11
Italy 144A 4.50% 23 - 01.10.53	1 021 000	EUR	992 830	1 049 151	0,04
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.28	2 719 000	EUR	2 936 182	2 926 124	0,12
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.44	2 164 000	EUR	2 568 773	2 324 109	0,09
Italy 144A 5.00% 03 - 01.08.34	2 860 000	EUR	3 400 910	3 178 339	0,13
Italy 144A 5.00% 07 - 01.08.39	2 822 000	EUR	3 341 347	3 112 737	0,13
Italy 144A 5.00% 09 - 01.03.25	2 830 000	EUR	2 935 665	2 885 372	0,12
Italy 144A 5.00% 09 - 01.09.40	2 573 000	EUR	3 187 434	2 839 929	0,12
			178 988 718	172 342 456	7,06

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Japan 0.005% 21 - 20.03.26	232 300 000	JPY	1 575 566	1 490 979	0,06
Japan 0.005% 21 - 20.06.26	160 700 000	JPY	1 143 434	1 031 230	0,04
Japan 0.005% 21 - 20.09.26	237 550 000	JPY	1 711 133	1 523 638	0,06
Japan 0.005% 22 - 20.12.26	293 800 000	JPY	2 080 566	1 883 914	0,08
Japan 0.005% 22 - 20.03.27	251 600 000	JPY	1 667 649	1 612 526	0,07
Japan 0.005% 22 - 20.06.27	333 200 000	JPY	2 353 806	2 133 454	0,09
Japan 0.005% 23 - 01.01.25	296 650 000	JPY	2 069 559	1 905 599	0,08
Japan 0.005% 23 - 01.02.25	227 850 000	JPY	1 501 023	1 463 617	0,06
Japan 0.005% 23 - 01.03.25	200 650 000	JPY	1 360 831	1 288 856	0,05
Japan 0.005% 23 - 01.04.25	143 050 000	JPY	952 262	918 831	0,04
Japan 0.005% 23 - 01.05.25	224 700 000	JPY	1 476 546	1 443 007	0,06
Japan 0.005% 23 - 01.06.25	178 800 000	JPY	1 138 212	1 148 321	0,05
Japan 0.005% 23 - 01.07.25	160 000 000	JPY	1 021 535	1 027 519	0,04
Japan 0.005% 23 - 01.08.25	289 700 000	JPY	1 831 309	1 860 582	0,08
Japan 0.005% 23 - 01.09.25	255 000 000	JPY	1 611 861	1 637 330	0,07
Japan 0.005% 23 - 01.10.25	235 000 000	JPY	1 461 884	1 508 761	0,06
Japan 0.005% 23 - 01.12.25	320 000 000	JPY	2 044 741	2 053 949	0,08
Japan 0.10% 16 - 20.03.26	79 850 000	JPY	582 522	513 581	0,02
Japan 0.10% 16 - 20.06.26	95 850 000	JPY	721 337	616 520	0,03
Japan 0.10% 16 - 20.09.26	125 100 000	JPY	944 053	804 452	0,03
Japan 0.10% 16 - 20.12.26	172 400 000	JPY	1 200 957	1 108 580	0,05
Japan 0.10% 17 - 20.03.27	152 250 000	JPY	1 082 223	978 755	0,04
Japan 0.10% 17 - 20.06.27	119 000 000	JPY	865 079	764 454	0,03
Japan 0.10% 17 - 20.09.27	151 550 000	JPY	1 123 779	972 728	0,04
Japan 0.10% 17 - 20.12.27	121 900 000	JPY	901 017	781 659	0,03
Japan 0.10% 18 - 20.03.28	145 150 000	JPY	1 074 866	929 710	0,04
Japan 0.10% 18 - 20.06.28	110 800 000	JPY	784 991	708 875	0,03
Japan 0.10% 18 - 20.09.28	134 700 000	JPY	974 652	860 294	0,04
Japan 0.10% 19 - 20.12.28	121 400 000	JPY	864 298	774 828	0,03
Japan 0.10% 19 - 20.03.29	54 050 000	JPY	351 493	344 679	0,01
Japan 0.10% 19 - 20.06.29	109 900 000	JPY	720 602	700 371	0,03
Japan 0.10% 19 - 20.09.29	114 000 000	JPY	865 120	725 790	0,03
Japan 0.10% 20 - 20.12.29	115 950 000	JPY	797 717	737 445	0,03
Japan 0.10% 20 - 20.03.30	130 000 000	JPY	870 172	825 660	0,03
Japan 0.10% 20 - 20.03.25	177 750 000	JPY	1 344 274	1 143 039	0,05
Japan 0.10% 20 - 20.06.30	145 650 000	JPY	1 050 548	923 018	0,04
Japan 0.10% 20 - 20.06.25	205 550 000	JPY	1 541 162	1 321 704	0,05
Japan 0.10% 20 - 20.09.30	123 650 000	JPY	922 156	782 027	0,03
Japan 0.10% 20 - 20.09.25	190 900 000	JPY	1 393 733	1 227 662	0,05
Japan 0.10% 21 - 20.12.30	120 100 000	JPY	841 446	757 439	0,03
Japan 0.10% 21 - 20.12.25	182 500 000	JPY	1 332 358	1 173 760	0,05
Japan 0.10% 21 - 20.03.31	123 750 000	JPY	840 900	778 535	0,03
Japan 0.10% 21 - 20.06.31	183 050 000	JPY	1 253 935	1 147 759	0,05
Japan 0.10% 21 - 20.09.31	160 950 000	JPY	1 132 479	1 006 398	0,04
Japan 0.10% 22 - 20.12.31	136 950 000	JPY	1 013 007	853 867	0,04
Japan 0.10% 22 - 20.03.27	131 750 000	JPY	934 445	846 969	0,03
Japan 0.10% 22 - 20.09.27	310 250 000	JPY	2 099 530	1 991 348	0,08
Japan 0.10% 23 - 20.03.28	261 950 000	JPY	1 695 496	1 677 834	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.10% 23 - 20.06.28	184 450 000	JPY	1 169 093	1 180 071	0,05
Japan 0.10% 23 - 01.11.25	260 000 000	JPY	1 614 101	1 672 590	0,07
Japan 0.20% 16 - 20.06.36	162 050 000	JPY	1 180 863	958 355	0,04
Japan 0.20% 22 - 20.06.32	78 800 000	JPY	505 928	492 892	0,02
Japan 0.20% 22 - 20.09.32	77 450 000	JPY	471 882	483 254	0,02
Japan 0.20% 23 - 20.12.27	146 750 000	JPY	988 567	944 717	0,04
Japan 0.20% 23 - 20.03.28	188 400 000	JPY	1 223 538	1 211 791	0,05
Japan 0.20% 23 - 20.06.28	140 850 000	JPY	890 597	905 126	0,04
Japan 0.30% 15 - 20.12.25	82 800 000	JPY	591 041	534 612	0,02
Japan 0.30% 16 - 20.06.46	131 050 000	JPY	781 216	651 271	0,03
Japan 0.30% 19 - 20.06.39	325 200 000	JPY	2 359 368	1 845 911	0,08
Japan 0.30% 19 - 20.09.39	227 950 000	JPY	1 656 728	1 287 984	0,05
Japan 0.30% 20 - 20.12.39	378 600 000	JPY	2 689 199	2 127 847	0,09
Japan 0.30% 23 - 20.12.27	130 650 000	JPY	872 630	844 377	0,03
Japan 0.30% 23 - 20.06.28	238 000 000	JPY	1 505 377	1 536 183	0,06
Japan 0.30% 23 - 20.09.28	188 000 000	JPY	1 164 018	1 211 958	0,05
Japan 0.40% 15 - 20.03.25	191 400 000	JPY	1 292 603	1 235 253	0,05
Japan 0.40% 15 - 20.06.25	82 500 000	JPY	607 398	532 797	0,02
Japan 0.40% 15 - 20.09.25	83 050 000	JPY	589 263	536 824	0,02
Japan 0.40% 16 - 20.03.36	149 400 000	JPY	1 117 320	909 733	0,04
Japan 0.40% 16 - 20.03.56	283 550 000	JPY	1 646 058	1 245 913	0,05
Japan 0.40% 19 - 20.03.39	234 150 000	JPY	1 694 542	1 357 146	0,06
Japan 0.40% 19 - 20.06.49	204 250 000	JPY	1 373 355	987 455	0,04
Japan 0.40% 19 - 20.09.49	174 500 000	JPY	1 227 711	840 097	0,03
Japan 0.40% 20 - 20.12.49	275 000 000	JPY	1 922 846	1 319 539	0,05
Japan 0.40% 20 - 20.03.50	263 550 000	JPY	1 610 569	1 259 284	0,05
Japan 0.40% 20 - 20.03.40	297 550 000	JPY	1 935 671	1 692 517	0,07
Japan 0.40% 20 - 20.06.40	400 050 000	JPY	2 792 945	2 262 171	0,09
Japan 0.40% 20 - 20.09.40	398 700 000	JPY	2 925 787	2 244 194	0,09
Japan 0.40% 21 - 20.06.41	403 950 000	JPY	2 831 741	2 240 259	0,09
Japan 0.40% 23 - 20.06.33	462 200 000	JPY	2 854 954	2 915 090	0,12
Japan 0.40% 23 - 20.09.28	409 950 000	JPY	2 592 236	2 655 045	0,11
Japan 0.50% 16 - 20.09.36	275 700 000	JPY	1 976 539	1 687 905	0,07
Japan 0.50% 16 - 20.09.46	192 900 000	JPY	1 201 091	1 001 749	0,04
Japan 0.50% 18 - 20.03.38	259 800 000	JPY	1 856 952	1 554 393	0,06
Japan 0.50% 18 - 20.06.38	305 700 000	JPY	2 209 567	1 821 870	0,07
Japan 0.50% 19 - 20.12.38	286 100 000	JPY	1 978 400	1 690 382	0,07
Japan 0.50% 19 - 20.03.49	202 050 000	JPY	1 288 683	1 007 762	0,04
Japan 0.50% 19 - 20.03.59	344 050 000	JPY	2 138 664	1 511 572	0,06
Japan 0.50% 20 - 20.03.60	417 200 000	JPY	2 535 285	1 813 478	0,07
Japan 0.50% 21 - 20.12.40	375 250 000	JPY	2 649 736	2 137 235	0,09
Japan 0.50% 21 - 20.03.41	346 150 000	JPY	2 461 190	1 962 694	0,08
Japan 0.50% 21 - 20.09.41	418 950 000	JPY	2 832 593	2 355 514	0,10
Japan 0.50% 22 - 20.12.41	487 550 000	JPY	3 223 035	2 732 415	0,11
Japan 0.50% 23 - 20.12.32	118 100 000	JPY	784 382	754 797	0,03
Japan 0.50% 23 - 20.03.33	246 350 000	JPY	1 617 224	1 571 444	0,06
Japan 0.60% 16 - 20.12.36	234 100 000	JPY	1 666 182	1 447 364	0,06
Japan 0.60% 16 - 20.12.46	157 200 000	JPY	924 797	832 778	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.60% 17 - 20.06.37	171 550 000	JPY	1 268 872	1 052 354	0,04
Japan 0.60% 17 - 20.09.37	262 550 000	JPY	1 924 738	1 604 936	0,07
Japan 0.60% 17 - 20.12.37	227 150 000	JPY	1 661 088	1 383 756	0,06
Japan 0.60% 20 - 20.06.50	268 450 000	JPY	1 784 796	1 351 579	0,06
Japan 0.60% 20 - 20.09.50	288 650 000	JPY	1 990 396	1 447 739	0,06
Japan 0.70% 17 - 20.03.37	213 950 000	JPY	1 408 174	1 334 571	0,05
Japan 0.70% 18 - 20.06.48	249 000 000	JPY	1 652 523	1 323 860	0,05
Japan 0.70% 18 - 20.09.38	229 150 000	JPY	1 674 660	1 400 192	0,06
Japan 0.70% 19 - 20.12.48	197 850 000	JPY	1 241 876	1 043 678	0,04
Japan 0.70% 21 - 20.12.50	317 500 000	JPY	2 205 355	1 633 478	0,07
Japan 0.70% 21 - 20.03.51	290 800 000	JPY	1 960 499	1 490 734	0,06
Japan 0.70% 21 - 20.03.61	469 350 000	JPY	2 899 072	2 174 940	0,09
Japan 0.70% 21 - 20.06.51	319 400 000	JPY	2 098 611	1 631 358	0,07
Japan 0.70% 21 - 20.09.51	315 250 000	JPY	1 887 644	1 605 748	0,07
Japan 0.70% 22 - 20.12.51	326 950 000	JPY	2 113 801	1 662 299	0,07
Japan 0.80% 16 - 20.03.46	184 100 000	JPY	1 298 511	1 030 265	0,04
Japan 0.80% 17 - 20.03.47	161 750 000	JPY	1 216 058	893 868	0,04
Japan 0.80% 17 - 20.06.47	142 500 000	JPY	1 086 136	785 622	0,03
Japan 0.80% 17 - 20.09.47	173 200 000	JPY	1 191 849	951 805	0,04
Japan 0.80% 17 - 20.12.47	187 950 000	JPY	1 405 964	1 029 519	0,04
Japan 0.80% 18 - 20.03.48	166 100 000	JPY	1 214 394	907 647	0,04
Japan 0.80% 18 - 20.03.58	235 850 000	JPY	1 521 688	1 166 199	0,05
Japan 0.80% 22 - 20.03.42	430 200 000	JPY	2 908 720	2 534 594	0,10
Japan 0.80% 23 - 20.09.33	589 600 000	JPY	3 755 010	3 849 368	0,16
Japan 0.90% 17 - 20.03.57	250 900 000	JPY	1 721 007	1 291 752	0,05
Japan 0.90% 18 - 20.09.48	165 850 000	JPY	1 122 710	921 329	0,04
Japan 0.90% 22 - 20.06.42	424 000 000	JPY	2 866 527	2 533 460	0,10
Japan 1.00% 15 - 20.12.35	266 750 000	JPY	2 040 665	1 747 187	0,07
Japan 1.00% 22 - 20.03.52	309 400 000	JPY	2 030 385	1 701 790	0,07
Japan 1.00% 22 - 20.03.62	414 700 000	JPY	2 397 457	2 110 653	0,09
Japan 1.10% 22 - 20.09.42	337 750 000	JPY	2 269 205	2 083 752	0,09
Japan 1.10% 23 - 20.03.43	319 000 000	JPY	2 033 437	1 958 365	0,08
Japan 1.10% 23 - 20.06.43	369 950 000	JPY	2 244 381	2 264 357	0,09
Japan 1.20% 14 - 20.12.34	258 800 000	JPY	2 048 008	1 743 391	0,07
Japan 1.20% 15 - 20.03.35	249 400 000	JPY	1 933 834	1 677 858	0,07
Japan 1.20% 15 - 20.09.35	236 200 000	JPY	1 771 847	1 583 579	0,06
Japan 1.20% 23 - 20.06.53	289 500 000	JPY	1 671 764	1 664 034	0,07
Japan 1.30% 15 - 20.06.35	201 350 000	JPY	1 529 936	1 366 997	0,06
Japan 1.30% 22 - 20.06.52	326 850 000	JPY	2 239 001	1 934 988	0,08
Japan 1.30% 23 - 20.03.63	276 400 000	JPY	1 568 150	1 536 804	0,06
Japan 1.40% 14 - 20.09.34	253 650 000	JPY	1 997 053	1 743 309	0,07
Japan 1.40% 15 - 20.03.55	120 400 000	JPY	843 451	723 272	0,03
Japan 1.40% 15 - 20.09.45	70 300 000	JPY	507 074	445 557	0,02
Japan 1.40% 15 - 20.12.45	100 150 000	JPY	829 876	633 465	0,03
Japan 1.40% 22 - 20.09.52	273 450 000	JPY	1 818 393	1 657 835	0,07
Japan 1.40% 23 - 20.12.42	328 200 000	JPY	2 330 749	2 123 631	0,09
Japan 1.40% 23 - 20.03.53	331 900 000	JPY	2 180 697	2 007 701	0,08
Japan 1.50% 12 - 20.06.32	67 900 000	JPY	506 850	471 396	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.50% 13 - 20.03.33	73 300 000	JPY	631 072	509 615	0,02
Japan 1.50% 14 - 20.03.34	234 350 000	JPY	1 884 623	1 628 780	0,07
Japan 1.50% 14 - 20.06.34	203 900 000	JPY	1 752 881	1 415 863	0,06
Japan 1.50% 14 - 20.12.44	103 400 000	JPY	801 618	670 939	0,03
Japan 1.50% 15 - 20.03.45	158 300 000	JPY	1 290 379	1 025 364	0,04
Japan 1.50% 23 - 20.09.43	395 000 000	JPY	2 487 893	2 584 625	0,11
Japan 1.60% 10 - 20.06.30	101 400 000	JPY	830 769	705 330	0,03
Japan 1.60% 12 - 20.03.32	97 700 000	JPY	792 118	683 125	0,03
Japan 1.60% 12 - 20.06.32	90 850 000	JPY	750 584	635 463	0,03
Japan 1.60% 13 - 20.03.33	119 250 000	JPY	1 021 327	835 788	0,03
Japan 1.60% 13 - 20.12.33	167 700 000	JPY	1 380 085	1 176 296	0,05
Japan 1.60% 15 - 20.06.45	92 500 000	JPY	765 603	609 287	0,02
Japan 1.60% 23 - 20.12.52	246 050 000	JPY	1 741 575	1 561 314	0,06
Japan 1.70% 03 - 20.06.33	88 300 000	JPY	700 487	624 561	0,03
Japan 1.70% 11 - 20.09.31	85 700 000	JPY	717 158	602 588	0,02
Japan 1.70% 11 - 20.12.31	148 500 000	JPY	1 180 024	1 044 854	0,04
Japan 1.70% 12 - 20.03.32	119 000 000	JPY	944 801	838 093	0,03
Japan 1.70% 12 - 20.06.32	43 800 000	JPY	379 874	308 646	0,01
Japan 1.70% 12 - 20.09.32	286 000 000	JPY	2 309 600	2 018 703	0,08
Japan 1.70% 12 - 20.12.32	174 300 000	JPY	1 469 197	1 231 231	0,05
Japan 1.70% 13 - 20.06.33	186 100 000	JPY	1 472 192	1 316 317	0,05
Japan 1.70% 13 - 20.09.33	174 550 000	JPY	1 489 571	1 234 274	0,05
Japan 1.70% 13 - 20.12.43	137 400 000	JPY	1 189 025	928 146	0,04
Japan 1.70% 14 - 20.03.44	198 900 000	JPY	1 601 633	1 341 641	0,05
Japan 1.70% 14 - 20.03.54	122 500 000	JPY	1 075 341	794 143	0,03
Japan 1.70% 14 - 20.06.44	139 650 000	JPY	1 164 351	941 470	0,04
Japan 1.70% 14 - 20.09.44	157 400 000	JPY	1 289 501	1 059 679	0,04
Japan 1.80% 02 - 22.11.32	65 900 000	JPY	550 648	469 008	0,02
Japan 1.80% 10 - 20.06.30	87 900 000	JPY	659 526	618 582	0,03
Japan 1.80% 10 - 20.09.30	57 400 000	JPY	438 739	404 559	0,02
Japan 1.80% 11 - 20.06.31	95 050 000	JPY	742 170	671 951	0,03
Japan 1.80% 11 - 20.09.31	192 900 000	JPY	1 590 763	1 365 591	0,06
Japan 1.80% 12 - 20.12.31	159 200 000	JPY	1 324 088	1 128 001	0,05
Japan 1.80% 12 - 20.03.32	139 700 000	JPY	1 186 389	990 965	0,04
Japan 1.80% 13 - 20.12.32	102 550 000	JPY	825 535	730 035	0,03
Japan 1.80% 13 - 20.03.43	239 150 000	JPY	2 094 174	1 648 597	0,07
Japan 1.80% 13 - 20.09.43	154 400 000	JPY	1 289 522	1 061 333	0,04
Japan 1.80% 23 - 20.09.53	282 550 000	JPY	1 808 993	1 876 148	0,08
Japan 1.90% 05 - 20.03.25	53 700 000	JPY	412 975	352 806	0,01
Japan 1.90% 05 - 20.06.25	49 650 000	JPY	383 070	327 616	0,01
Japan 1.90% 09 - 20.12.28	112 450 000	JPY	934 327	781 839	0,03
Japan 1.90% 09 - 20.03.29	151 550 000	JPY	1 213 154	1 057 069	0,04
Japan 1.90% 10 - 20.09.30	132 300 000	JPY	1 077 209	938 040	0,04
Japan 1.90% 11 - 20.03.31	93 050 000	JPY	755 898	661 702	0,03
Japan 1.90% 11 - 20.06.31	154 500 000	JPY	1 284 566	1 099 412	0,05
Japan 1.90% 12 - 20.09.42	408 450 000	JPY	3 508 332	2 864 776	0,12
Japan 1.90% 13 - 20.03.53	132 850 000	JPY	1 202 146	901 889	0,04
Japan 1.90% 13 - 20.06.43	212 650 000	JPY	1 686 385	1 486 631	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.00% 04 - 20.12.33	63 900 000	JPY	546 747	464 051	0,02
Japan 2.00% 05 - 20.09.25	89 800 000	JPY	669 741	596 225	0,02
Japan 2.00% 06 - 20.12.25	79 450 000	JPY	542 228	529 966	0,02
Japan 2.00% 07 - 20.03.27	68 900 000	JPY	504 668	469 821	0,02
Japan 2.00% 10 - 20.06.30	116 050 000	JPY	943 358	826 132	0,03
Japan 2.00% 10 - 20.09.40	381 650 000	JPY	3 304 571	2 737 313	0,11
Japan 2.00% 11 - 20.12.30	86 100 000	JPY	685 509	615 148	0,03
Japan 2.00% 11 - 20.03.31	158 200 000	JPY	1 346 196	1 132 131	0,05
Japan 2.00% 11 - 20.09.41	373 100 000	JPY	3 030 734	2 662 742	0,11
Japan 2.00% 12 - 20.03.42	336 600 000	JPY	3 008 171	2 401 578	0,10
Japan 2.00% 12 - 20.03.52	226 650 000	JPY	2 061 782	1 572 775	0,06
Japan 2.10% 03 - 20.09.33	39 200 000	JPY	337 279	286 692	0,01
Japan 2.10% 05 - 20.03.25	37 850 000	JPY	297 892	249 258	0,01
Japan 2.10% 05 - 20.09.25	50 350 000	JPY	428 082	334 847	0,01
Japan 2.10% 05 - 20.12.25	96 300 000	JPY	736 957	643 574	0,03
Japan 2.10% 06 - 20.03.26	142 000 000	JPY	1 027 651	953 511	0,04
Japan 2.10% 06 - 20.12.26	171 100 000	JPY	1 410 340	1 165 141	0,05
Japan 2.10% 07 - 20.03.27	120 450 000	JPY	1 028 248	823 810	0,03
Japan 2.10% 07 - 20.06.27	58 800 000	JPY	468 355	403 760	0,02
Japan 2.10% 07 - 20.09.27	83 850 000	JPY	625 367	577 977	0,02
Japan 2.10% 07 - 20.12.27	202 100 000	JPY	1 615 255	1 398 134	0,06
Japan 2.10% 08 - 20.06.28	64 450 000	JPY	498 427	449 132	0,02
Japan 2.10% 08 - 20.09.28	108 050 000	JPY	903 274	755 132	0,03
Japan 2.10% 08 - 20.12.28	74 100 000	JPY	619 524	519 868	0,02
Japan 2.10% 09 - 20.03.29	141 650 000	JPY	1 097 838	997 376	0,04
Japan 2.10% 09 - 20.06.29	150 850 000	JPY	1 292 660	1 066 271	0,04
Japan 2.10% 09 - 20.09.29	127 200 000	JPY	1 038 085	902 288	0,04
Japan 2.10% 09 - 20.12.29	130 800 000	JPY	1 134 735	930 714	0,04
Japan 2.10% 10 - 20.03.30	220 650 000	JPY	1 790 809	1 575 217	0,06
Japan 2.10% 10 - 20.12.30	225 200 000	JPY	1 853 367	1 618 791	0,07
Japan 2.20% 06 - 20.03.26	56 350 000	JPY	432 096	379 182	0,02
Japan 2.20% 06 - 20.06.26	46 600 000	JPY	372 529	315 169	0,01
Japan 2.20% 06 - 20.09.26	113 750 000	JPY	920 121	772 975	0,03
Japan 2.20% 07 - 20.09.27	82 250 000	JPY	672 784	568 897	0,02
Japan 2.20% 08 - 20.03.28	175 750 000	JPY	1 354 758	1 224 703	0,05
Japan 2.20% 08 - 20.09.28	70 450 000	JPY	543 522	494 469	0,02
Japan 2.20% 09 - 20.03.49	155 050 000	JPY	1 377 501	1 122 252	0,05
Japan 2.20% 09 - 20.06.29	75 150 000	JPY	626 659	533 793	0,02
Japan 2.20% 09 - 20.09.39	279 200 000	JPY	2 493 189	2 065 401	0,08
Japan 2.20% 10 - 20.12.29	81 750 000	JPY	640 865	584 778	0,02
Japan 2.20% 10 - 20.03.30	110 450 000	JPY	902 839	792 827	0,03
Japan 2.20% 10 - 20.03.50	118 550 000	JPY	938 549	857 487	0,04
Japan 2.20% 11 - 20.03.31	120 650 000	JPY	1 056 499	874 288	0,04
Japan 2.20% 11 - 20.03.41	302 900 000	JPY	2 622 985	2 226 739	0,09
Japan 2.20% 11 - 20.03.51	210 400 000	JPY	1 857 975	1 520 444	0,06
Japan 2.30% 02 - 20.05.32	60 550 000	JPY	482 924	445 676	0,02
Japan 2.30% 05 - 20.03.35	116 000 000	JPY	1 080 298	868 784	0,04
Japan 2.30% 05 - 20.06.35	93 700 000	JPY	864 377	701 804	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.30% 06 - 20.12.35	91 550 000	JPY	772 275	686 271	0,03
Japan 2.30% 06 - 20.03.26	70 250 000	JPY	566 946	473 709	0,02
Japan 2.30% 06 - 20.06.26	90 750 000	JPY	709 606	615 195	0,03
Japan 2.30% 07 - 20.12.36	83 250 000	JPY	778 218	625 347	0,03
Japan 2.30% 07 - 20.06.27	118 350 000	JPY	827 763	817 906	0,03
Japan 2.30% 08 - 20.06.28	70 150 000	JPY	588 951	492 841	0,02
Japan 2.30% 09 - 20.03.39	285 500 000	JPY	2 267 346	2 140 037	0,09
Japan 2.30% 10 - 20.03.40	331 500 000	JPY	2 953 961	2 477 646	0,10
Japan 2.40% 04 - 20.03.34	98 350 000	JPY	866 029	739 417	0,03
Japan 2.40% 05 - 20.12.34	73 450 000	JPY	713 609	554 265	0,02
Japan 2.40% 07 - 20.03.37	233 000 000	JPY	1 954 724	1 768 698	0,07
Japan 2.40% 07 - 20.03.48	65 400 000	JPY	644 408	492 011	0,02
Japan 2.40% 08 - 20.03.28	75 300 000	JPY	675 877	528 766	0,02
Japan 2.40% 08 - 20.06.28	139 450 000	JPY	1 080 010	983 667	0,04
Japan 2.40% 08 - 20.09.38	245 350 000	JPY	2 239 355	1 862 714	0,08
Japan 2.50% 04 - 20.06.34	110 000 000	JPY	1 013 156	834 916	0,03
Japan 2.50% 04 - 20.09.34	101 500 000	JPY	911 342	771 371	0,03
Japan 2.50% 05 - 20.09.35	104 100 000	JPY	939 058	794 920	0,03
Japan 2.50% 06 - 20.03.36	119 450 000	JPY	1 051 054	913 684	0,04
Japan 2.50% 06 - 20.06.36	104 600 000	JPY	1 007 182	800 498	0,03
Japan 2.50% 06 - 20.09.36	64 850 000	JPY	614 420	496 726	0,02
Japan 2.50% 07 - 20.09.37	196 000 000	JPY	1 737 125	1 503 727	0,06
Japan 2.50% 08 - 20.03.38	246 950 000	JPY	2 241 226	1 895 222	0,08
			364 342 473	314 975 314	12,90
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.07.30	1 512 000	EUR	1 456 803	1 311 962	0,05
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.27	1 690 000	EUR	1 625 469	1 580 319	0,06
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.52	2 000 000	EUR	1 271 782	1 025 600	0,04
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.07.31	1 683 000	EUR	1 516 515	1 425 501	0,06
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.38	1 154 000	EUR	954 224	813 916	0,03
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.29	1 489 000	EUR	1 382 697	1 336 378	0,05
Netherlands 144A Zero Coupon 22 - 15.01.26	1 552 000	EUR	1 495 755	1 475 320	0,06
Netherlands 144A 0.25% 15 - 15.07.25	2 164 000	EUR	2 124 586	2 088 693	0,09
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	1 415 000	EUR	1 360 995	1 275 198	0,05
Netherlands 144A 0.50% 16 - 15.07.26	2 056 000	EUR	2 037 876	1 965 947	0,08
Netherlands 144A 0.50% 19 - 15.01.40	1 819 000	EUR	1 541 465	1 344 059	0,06
Netherlands 144A 0.50% 22 - 15.07.32	1 476 000	EUR	1 354 177	1 268 917	0,05
Netherlands 144A 0.75% 17 - 15.07.27	2 039 000	EUR	1 983 414	1 940 312	0,08
Netherlands 144A 0.75% 18 - 15.07.28	2 343 000	EUR	2 317 255	2 200 780	0,09
Netherlands 144A 2.00% 22 - 15.01.54	891 000	EUR	773 979	802 078	0,03
Netherlands 144A 2.50% 12 - 15.01.33	1 765 000	EUR	1 952 976	1 788 828	0,07
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.07.33	1 359 000	EUR	1 320 592	1 374 221	0,06
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.01.30	854 000	EUR	845 259	868 603	0,04
Netherlands 144A 2.75% 14 - 15.01.47	2 253 000	EUR	2 848 406	2 355 737	0,10
Netherlands 144A 3.25% 23 - 15.01.44	550 000	EUR	550 718	610 866	0,03
Netherlands 144A 3.75% 10 - 15.01.42	2 059 000	EUR	2 819 697	2 422 620	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 4.00% 05 - 15.01.37	2 134 000	EUR	2 809 837	2 485 470	0,10
Netherlands 144A 5.50% 98 - 15.01.28	1 362 000	EUR	1 626 500	1 531 841	0,06
			37 970 977	35 293 166	1,44
Nouvelle-Zélande					
New Zealand 0.25% 20 - 15.05.28	1 016 000	NZD	486 490	491 631	0,02
New Zealand 0.50% 21 - 15.05.26	842 000	NZD	431 740	440 660	0,02
New Zealand 1.50% 19 - 15.05.31	779 000	NZD	375 166	368 806	0,01
New Zealand 1.75% 20 - 15.05.41	600 000	NZD	233 441	226 081	0,01
New Zealand 2.00% 21 - 15.05.32	931 000	NZD	446 128	447 982	0,02
New Zealand 2.75% 16 - 15.04.25	700 000	NZD	398 564	390 049	0,02
New Zealand 2.75% 16 - 15.04.37	672 000	NZD	321 545	316 446	0,01
New Zealand 2.75% 21 - 15.05.51	720 000	NZD	293 812	294 261	0,01
New Zealand 3.00% 18 - 20.04.29	1 103 000	NZD	601 552	597 699	0,02
New Zealand 3.50% 15 - 14.04.33	1 336 000	NZD	704 730	717 296	0,03
New Zealand 4.25% 22 - 15.05.34	749 000	NZD	426 305	424 421	0,02
New Zealand 4.50% 14 - 15.04.27	1 297 000	NZD	734 954	748 166	0,03
New Zealand 4.50% 23 - 15.05.30	650 000	NZD	373 863	378 291	0,02
			5 828 290	5 841 789	0,24
Norvège					
Norway 144A 1.25% 21 - 17.09.31	3 807 000	NOK	327 130	292 829	0,01
Norway 144A 1.375% 20 - 19.08.30	6 397 000	NOK	588 701	504 804	0,02
Norway 144A 1.50% 16 - 19.02.26	5 985 000	NOK	553 699	510 596	0,02
Norway 144A 1.75% 15 - 13.03.25	6 833 000	NOK	604 186	594 100	0,02
Norway 144A 1.75% 17 - 17.02.27	6 186 000	NOK	576 159	525 219	0,02
Norway 144A 1.75% 19 - 06.09.29	4 517 000	NOK	429 676	370 589	0,02
Norway 144A 2.00% 18 - 26.04.28	4 870 000	NOK	468 735	412 052	0,02
Norway 144A 2.125% 22 - 18.05.32	4 275 000	NOK	407 902	348 314	0,01
Norway 144A 3.00% 23 - 15.08.33	5 150 000	NOK	424 411	447 747	0,02
Norway 144A 3.50% 22 - 06.10.42	1 880 000	NOK	153 353	175 725	0,01
			4 533 952	4 181 975	0,17
Singapour					
Singapore Zero Coupon 21 - 01.07.31	710 000	SGD	446 208	450 808	0,02
Singapore Zero Coupon 21 - 01.11.26	671 000	SGD	436 255	439 492	0,02
Singapore 0.50% 20 - 01.11.25	715 000	SGD	461 674	466 691	0,02
Singapore 1.875% 20 - 01.03.50	635 000	SGD	416 818	366 189	0,01
Singapore 1.875% 21 - 01.10.51	784 000	SGD	451 366	451 576	0,02
Singapore 2.125% 16 - 01.06.26	817 000	SGD	539 526	548 183	0,02
Singapore 2.25% 16 - 01.08.36	885 000	SGD	578 851	575 892	0,02
Singapore 2.375% 15 - 01.06.25	962 000	SGD	634 972	650 227	0,03
Singapore 2.375% 19 - 01.07.39	632 000	SGD	409 710	412 429	0,02
Singapore 2.625% 18 - 01.05.28	905 000	SGD	615 259	619 898	0,02
Singapore 2.625% 22 - 01.08.32	745 000	SGD	509 117	507 440	0,02
Singapore 2.75% 12 - 01.04.42	656 000	SGD	451 866	449 295	0,02
Singapore 2.75% 16 - 01.03.46	750 000	SGD	513 259	512 492	0,02
Singapore 2.875% 10 - 01.09.30	1 101 000	SGD	756 967	761 103	0,03
Singapore 2.875% 14 - 01.07.29	789 000	SGD	553 393	545 260	0,02
Singapore 2.875% 22 - 01.09.27	225 000	SGD	155 823	155 199	0,01
Singapore 2.875% 23 - 01.08.28	200 000	SGD	135 174	138 421	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Singapour (suite)					
Singapore 3.00% 22 - 01.08.72	585 000	SGD	415 139	429 453	0,02
Singapore 3.375% 13 - 01.09.33	899 000	SGD	628 945	651 757	0,03
Singapore 3.50% 07 - 01.03.27	1 120 000	SGD	773 898	782 693	0,03
			9 884 220	9 914 498	0,41
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	2 230 000	EUR	2 206 548	2 156 744	0,09
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	2 495 000	EUR	2 428 301	2 360 245	0,10
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	3 242 000	EUR	3 016 921	2 926 424	0,12
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.27	2 609 000	EUR	2 468 135	2 412 881	0,10
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	2 124 000	EUR	2 071 347	2 038 105	0,08
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	3 126 000	EUR	2 787 012	2 832 750	0,12
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	2 498 000	EUR	2 474 131	2 507 318	0,10
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	2 765 000	EUR	3 591 413	3 368 101	0,14
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	2 860 000	EUR	3 465 452	3 319 805	0,14
Spain 144A 0.10% 21 - 30.04.31	2 822 000	EUR	2 444 219	2 330 520	0,10
Spain 144A 0.50% 20 - 30.04.30	2 924 000	EUR	2 726 602	2 558 442	0,10
Spain 144A 0.50% 21 - 31.10.31	2 594 000	EUR	2 374 841	2 179 842	0,09
Spain 144A 0.60% 19 - 31.10.29	3 032 000	EUR	2 810 071	2 702 846	0,11
Spain 144A 0.70% 22 - 30.04.32	2 669 000	EUR	2 327 838	2 250 154	0,09
Spain 144A 0.80% 20 - 30.07.27	2 589 000	EUR	2 510 405	2 435 654	0,10
Spain 144A 0.85% 21 - 30.07.37	1 739 000	EUR	1 441 888	1 277 365	0,05
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	2 512 000	EUR	1 849 227	1 407 649	0,06
Spain 144A 1.00% 21 - 30.07.42	1 294 000	EUR	973 238	863 189	0,04
Spain 144A 1.20% 20 - 31.10.40	2 041 000	EUR	1 623 800	1 454 641	0,06
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	2 748 000	EUR	2 632 409	2 498 509	0,10
Spain 144A 1.30% 16 - 31.10.26	3 103 000	EUR	3 097 003	2 996 471	0,12
Spain 144A 1.40% 18 - 30.04.28	3 111 000	EUR	3 080 487	2 966 501	0,12
Spain 144A 1.40% 18 - 30.07.28	2 746 000	EUR	2 727 557	2 609 979	0,11
Spain 144A 1.45% 17 - 31.10.27	2 655 000	EUR	2 637 431	2 550 761	0,10
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	2 253 000	EUR	2 244 804	2 126 635	0,09
Spain 144A 1.45% 21 - 31.10.71	885 000	EUR	511 134	433 039	0,02
Spain 144A 1.50% 17 - 30.04.27	3 092 000	EUR	3 082 342	2 989 150	0,12
Spain 144A 1.60% 15 - 30.04.25	2 499 000	EUR	2 480 702	2 453 337	0,10
Spain 144A 1.85% 19 - 30.07.35	2 412 000	EUR	2 322 890	2 110 645	0,09
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	2 048 000	EUR	1 481 034	1 414 902	0,06
Spain 144A 1.95% 15 - 30.07.30	2 688 000	EUR	2 687 310	2 568 837	0,10
Spain 144A 1.95% 16 - 30.04.26	2 443 000	EUR	2 460 369	2 404 393	0,10
Spain 144A 2.15% 15 - 31.10.25	3 037 000	EUR	3 074 017	3 005 230	0,12
Spain 144A 2.35% 17 - 30.07.33	2 545 000	EUR	2 598 985	2 417 573	0,10
Spain 144A 2.55% 22 - 31.10.32	2 507 000	EUR	2 423 114	2 442 269	0,10
Spain 144A 2.70% 18 - 31.10.48	2 066 000	EUR	2 102 232	1 772 040	0,07
Spain 144A 2.90% 16 - 31.10.46	2 296 000	EUR	2 479 384	2 069 056	0,08
Spain 144A 3.15% 23 - 30.04.33	2 781 000	EUR	2 721 294	2 825 107	0,12
Spain 144A 3.45% 16 - 30.07.66	1 625 000	EUR	1 957 768	1 499 718	0,06
Spain 144A 3.45% 22 - 30.07.43	1 504 000	EUR	1 421 812	1 488 990	0,06
Spain 144A 3.50% 23 - 31.05.29	850 000	EUR	859 154	887 145	0,04
Spain 144A 3.55% 23 - 31.10.33	2 652 000	EUR	2 652 326	2 775 159	0,11
Spain 144A 3.90% 23 - 30.07.39	1 105 000	EUR	1 116 216	1 170 018	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 4.20% 05 - 31.01.37	2 496 000	EUR	3 070 273	2 753 588	0,11
Spain 144A 4.65% 10 - 30.07.25	2 873 000	EUR	3 027 075	2 948 930	0,12
Spain 144A 4.70% 09 - 30.07.41	2 385 000	EUR	3 199 084	2 780 257	0,11
Spain 144A 4.90% 07 - 30.07.40	2 273 000	EUR	2 981 529	2 683 541	0,11
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.28	2 182 000	EUR	2 488 002	2 435 560	0,10
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.44	1 728 000	EUR	2 341 163	2 142 824	0,09
Spain 144A 5.90% 11 - 30.07.26	2 613 000	EUR	2 896 856	2 821 588	0,12
			120 447 145	114 424 427	4,69
Suède					
Sweden 0.125% 20 - 12.05.31	7 340 000	SEK	663 313	575 187	0,02
Sweden 0.75% 17 - 12.05.28	8 505 000	SEK	766 707	722 717	0,03
Sweden 0.75% 18 - 12.11.29	7 410 000	SEK	707 281	619 937	0,03
Sweden 1.00% 15 - 12.11.26	9 890 000	SEK	930 753	857 137	0,03
Sweden 1.75% 22 - 11.11.33	4 610 000	SEK	373 974	404 450	0,02
Sweden 2.25% 12 - 01.06.32	5 235 000	SEK	532 459	478 037	0,02
Sweden 2.50% 14 - 12.05.25	8 515 000	SEK	811 598	760 648	0,03
Sweden 3.50% 09 - 30.03.39	4 350 000	SEK	533 541	454 252	0,02
			5 319 626	4 872 365	0,20
Royaume-Uni					
United Kingdom 0.125% 20 - 30.01.26	2 013 000	GBP	2 199 952	2 160 448	0,09
United Kingdom 0.125% 20 - 31.01.28	1 860 000	GBP	1 931 490	1 883 550	0,08
United Kingdom 0.25% 20 - 31.07.31	3 104 000	GBP	3 085 877	2 831 300	0,12
United Kingdom 0.25% 21 - 31.01.25	2 833 000	GBP	3 189 729	3 128 131	0,13
United Kingdom 0.375% 20 - 22.10.30	2 026 000	GBP	1 969 807	1 915 577	0,08
United Kingdom 0.375% 21 - 22.10.26	2 881 000	GBP	3 197 892	3 047 476	0,12
United Kingdom 0.50% 20 - 22.10.61	2 604 000	GBP	1 679 257	1 019 028	0,04
United Kingdom 0.50% 21 - 31.01.29	3 221 000	GBP	3 338 850	3 226 842	0,13
United Kingdom 0.625% 19 - 07.06.25	1 761 000	GBP	1 986 209	1 935 715	0,08
United Kingdom 0.625% 20 - 22.10.50	1 861 000	GBP	1 206 694	949 261	0,04
United Kingdom 0.625% 20 - 31.07.35	2 320 000	GBP	2 189 756	1 904 667	0,08
United Kingdom 0.875% 19 - 22.10.29	1 715 000	GBP	1 795 542	1 728 006	0,07
United Kingdom 0.875% 21 - 31.01.46	1 948 000	GBP	1 580 830	1 202 932	0,05
United Kingdom 0.875% 21 - 31.07.33	3 234 000	GBP	3 025 925	2 923 754	0,12
United Kingdom 1.00% 21 - 31.01.32	3 898 000	GBP	3 805 548	3 728 732	0,15
United Kingdom 1.125% 21 - 31.01.39	2 744 000	GBP	2 377 977	2 154 595	0,09
United Kingdom 1.125% 22 - 22.10.73	1 142 000	GBP	772 148	551 147	0,02
United Kingdom 1.25% 17 - 22.07.27	1 778 000	GBP	1 940 769	1 904 747	0,08
United Kingdom 1.25% 20 - 22.10.41	2 625 000	GBP	2 614 024	1 968 458	0,08
United Kingdom 1.25% 21 - 31.07.51	2 915 000	GBP	2 289 913	1 793 684	0,07
United Kingdom 1.50% 16 - 22.07.26	1 864 000	GBP	2 096 254	2 045 428	0,08
United Kingdom 1.50% 16 - 22.07.47	2 191 000	GBP	2 010 407	1 536 052	0,06
United Kingdom 1.50% 21 - 31.07.53	1 823 000	GBP	1 346 843	1 172 867	0,05
United Kingdom 1.625% 18 - 22.10.28	1 662 000	GBP	1 816 003	1 776 066	0,07
United Kingdom 1.625% 18 - 22.10.71	1 860 000	GBP	1 774 980	1 112 314	0,04
United Kingdom 1.625% 19 - 22.10.54	1 826 000	GBP	1 687 162	1 205 984	0,05
United Kingdom 1.75% 16 - 07.09.37	2 554 000	GBP	2 578 076	2 286 882	0,09
United Kingdom 1.75% 17 - 22.07.57	2 046 000	GBP	2 129 309	1 376 076	0,06
United Kingdom 1.75% 18 - 22.01.49	1 344 000	GBP	1 370 375	981 949	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.00% 15 - 07.09.25	1 540 000	GBP	1 771 865	1 723 357	0,07
United Kingdom 2.50% 15 - 22.07.65	1 755 000	GBP	2 309 362	1 417 746	0,06
United Kingdom 3.25% 12 - 22.01.44	2 448 000	GBP	2 970 230	2 491 426	0,10
United Kingdom 3.25% 23 - 31.01.33	3 635 000	GBP	3 944 508	4 105 129	0,17
United Kingdom 3.50% 13 - 22.07.68	1 772 000	GBP	2 434 127	1 839 425	0,07
United Kingdom 3.50% 14 - 22.01.45	2 230 000	GBP	2 627 240	2 346 506	0,10
United Kingdom 3.50% 23 - 22.10.25	3 704 000	GBP	4 198 073	4 239 904	0,17
United Kingdom 3.75% 11 - 22.07.52	1 545 000	GBP	2 198 441	1 675 285	0,07
United Kingdom 3.75% 22 - 29.01.38	1 959 000	GBP	2 147 978	2 218 695	0,09
United Kingdom 3.75% 23 - 22.10.53	3 123 000	GBP	3 269 083	3 366 530	0,14
United Kingdom 4.00% 09 - 22.01.60	1 447 000	GBP	2 357 360	1 653 183	0,07
United Kingdom 4.00% 23 - 22.10.63	1 138 000	GBP	1 192 296	1 300 416	0,05
United Kingdom 4.125% 22 - 29.01.27	3 670 000	GBP	4 234 501	4 300 091	0,18
United Kingdom 4.25% 00 - 07.06.32	2 441 000	GBP	3 150 823	2 983 190	0,12
United Kingdom 4.25% 03 - 07.03.36	1 818 000	GBP	2 518 340	2 201 879	0,09
United Kingdom 4.25% 05 - 07.12.55	1 827 000	GBP	2 868 199	2 162 599	0,09
United Kingdom 4.25% 06 - 07.12.46	1 975 000	GBP	3 159 614	2 318 412	0,09
United Kingdom 4.25% 06 - 07.12.27	1 865 000	GBP	2 278 735	2 218 987	0,09
United Kingdom 4.25% 08 - 07.12.49	1 526 000	GBP	2 210 007	1 791 868	0,07
United Kingdom 4.25% 09 - 07.09.39	1 451 000	GBP	2 012 608	1 727 579	0,07
United Kingdom 4.25% 10 - 07.12.40	1 825 000	GBP	2 430 867	2 164 655	0,09
United Kingdom 4.50% 07 - 07.12.42	2 136 000	GBP	3 118 603	2 600 831	0,11
United Kingdom 4.50% 09 - 07.09.34	1 524 000	GBP	2 118 313	1 891 175	0,08
United Kingdom 4.50% 23 - 07.06.28	2 420 000	GBP	2 827 459	2 912 004	0,12
United Kingdom 4.625% 23 - 31.01.34	1 477 000	GBP	1 776 958	1 850 408	0,08
United Kingdom 4.75% 04 - 07.12.38	1 678 000	GBP	2 394 406	2 111 519	0,09
United Kingdom 4.75% 07 - 07.12.30	2 372 000	GBP	3 114 715	2 964 561	0,12
United Kingdom 4.75% 23 - 22.10.43	921 000	GBP	1 095 796	1 153 843	0,05
United Kingdom 5.00% 01 - 07.03.25	2 112 000	GBP	2 486 705	2 457 542	0,10
United Kingdom 6.00% 98 - 07.12.28	1 248 000	GBP	1 666 667	1 611 617	0,07
			139 871 477	125 252 030	5,13
États-Unis					
United States Zero Coupon 20 - 15.05.40	4 389 000	USD	3 244 017	2 566 441	0,11
United States Zero Coupon 20 - 30.06.27	4 439 000	USD	3 681 392	3 569 529	0,15
United States Zero Coupon 20 - 31.10.25	5 756 000	USD	4 936 432	4 840 251	0,20
United States Zero Coupon 20 - 31.10.27	5 511 000	USD	4 599 169	4 387 123	0,18
United States Zero Coupon 21 - 31.01.26	6 635 000	USD	5 616 396	5 548 437	0,23
United States Zero Coupon 21 - 31.03.26	6 351 000	USD	5 488 682	5 336 098	0,22
United States Zero Coupon 21 - 30.04.26	6 548 000	USD	5 630 194	5 484 019	0,22
United States Zero Coupon 21 - 30.04.28	6 894 000	USD	5 736 631	5 589 497	0,23
United States Zero Coupon 21 - 31.05.28	6 892 000	USD	5 830 128	5 577 152	0,23
United States Zero Coupon 21 - 15.05.41	6 573 000	USD	5 193 781	4 547 331	0,19
United States Zero Coupon 21 - 30.06.26	5 861 000	USD	4 996 115	4 906 992	0,20
United States Zero Coupon 21 - 31.07.26	6 060 000	USD	5 186 225	5 024 741	0,21
United States Zero Coupon 21 - 31.07.28	6 624 000	USD	5 501 476	5 275 956	0,22
United States Zero Coupon 21 - 31.08.28	6 648 000	USD	5 591 503	5 315 759	0,22
United States Zero Coupon 21 - 15.08.41	8 372 000	USD	6 013 063	5 286 262	0,22
United States Zero Coupon 21 - 30.09.26	6 433 000	USD	5 620 758	5 350 399	0,22

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 21 - 30.09.28	6 570 000	USD	5 577 422	5 272 905	0,22
United States Zero Coupon 21 - 30.11.26	6 398 000	USD	5 666 145	5 355 678	0,22
United States Zero Coupon 21 - 31.12.26	6 338 000	USD	5 591 798	5 297 384	0,22
United States Zero Coupon 21 - 31.12.28	6 352 000	USD	5 401 093	5 104 233	0,21
United States Zero Coupon 22 - 31.01.29	5 912 000	USD	5 140 757	4 831 781	0,20
United States Zero Coupon 22 - 28.02.27	5 891 000	USD	5 196 100	5 001 270	0,20
United States Zero Coupon 22 - 28.02.29	5 625 000	USD	4 833 339	4 619 499	0,19
United States Zero Coupon 22 - 15.02.42	5 870 000	USD	4 780 986	4 091 703	0,17
United States Zero Coupon 22 - 31.03.27	5 505 000	USD	4 992 808	4 763 894	0,20
United States Zero Coupon 22 - 31.03.29	5 195 000	USD	4 706 332	4 369 238	0,18
United States Zero Coupon 22 - 30.04.27	5 317 000	USD	4 857 860	4 631 286	0,19
United States Zero Coupon 22 - 30.04.29	4 897 000	USD	4 361 763	4 220 428	0,17
United States Zero Coupon 22 - 15.05.42	4 750 000	USD	4 275 634	3 784 675	0,15
United States Zero Coupon 22 - 31.07.27	5 522 000	USD	5 213 031	4 799 694	0,20
United States Zero Coupon 22 - 30.11.29	3 897 000	USD	3 719 706	3 524 506	0,14
United States Zero Coupon 23 - 31.12.24	4 566 000	USD	4 182 487	4 112 123	0,17
United States Zero Coupon 23 - 29.02.28	5 090 000	USD	4 722 922	4 625 073	0,19
United States Zero Coupon 23 - 15.02.43	4 350 000	USD	3 934 744	3 768 077	0,15
United States Zero Coupon 23 - 31.03.25	4 497 000	USD	4 111 460	4 035 351	0,17
United States Zero Coupon 23 - 30.04.28	4 784 000	USD	4 394 115	4 264 468	0,17
United States Zero Coupon 23 - 30.06.25	4 624 000	USD	4 226 149	4 196 406	0,17
United States Zero Coupon 23 - 30.06.30	3 896 000	USD	3 462 911	3 498 803	0,14
United States Zero Coupon 23 - 30.09.25	4 915 000	USD	4 617 867	4 495 257	0,18
United States Zero Coupon 23 - 30.09.28	5 810 000	USD	5 446 943	5 432 164	0,22
United States 0.25% 20 - 31.05.25	4 726 000	USD	4 166 911	4 028 935	0,16
United States 0.25% 20 - 30.06.25	4 832 000	USD	4 310 345	4 107 681	0,17
United States 0.25% 20 - 31.07.25	4 874 000	USD	4 227 609	4 131 665	0,17
United States 0.25% 20 - 31.08.25	5 251 000	USD	4 600 402	4 438 619	0,18
United States 0.25% 20 - 30.09.25	5 892 000	USD	5 138 441	4 967 116	0,20
United States 0.375% 20 - 30.04.25	4 661 000	USD	4 123 679	3 993 300	0,16
United States 0.375% 20 - 31.07.27	4 723 000	USD	3 940 379	3 771 847	0,15
United States 0.375% 20 - 30.09.27	5 308 000	USD	4 466 054	4 215 010	0,17
United States 0.375% 20 - 30.11.25	6 095 000	USD	5 252 300	5 123 594	0,21
United States 0.375% 20 - 31.12.25	6 166 000	USD	5 290 872	5 173 684	0,21
United States 0.50% 20 - 31.03.25	4 269 000	USD	3 881 623	3 673 759	0,15
United States 0.50% 20 - 30.04.27	3 609 000	USD	3 065 502	2 917 416	0,12
United States 0.50% 20 - 31.05.27	3 264 000	USD	2 796 096	2 631 602	0,11
United States 0.50% 20 - 31.08.27	4 165 000	USD	3 564 489	3 332 113	0,14
United States 0.50% 21 - 28.02.26	6 823 000	USD	5 890 222	5 707 579	0,23
United States 0.625% 20 - 31.03.27	2 445 000	USD	2 138 178	1 989 958	0,08
United States 0.625% 20 - 15.05.30	8 999 000	USD	7 266 292	6 662 286	0,27
United States 0.625% 20 - 15.08.30	11 337 000	USD	9 084 219	8 332 255	0,34
United States 0.625% 20 - 30.11.27	5 571 000	USD	4 606 717	4 446 707	0,18
United States 0.625% 20 - 31.12.27	6 542 000	USD	5 419 015	5 207 867	0,21
United States 0.75% 21 - 31.01.28	7 109 000	USD	5 830 599	5 675 326	0,23
United States 0.75% 21 - 31.05.26	6 945 000	USD	5 970 271	5 803 741	0,24
United States 0.75% 21 - 31.08.26	6 701 000	USD	5 751 077	5 562 871	0,23
United States 0.875% 20 - 15.11.30	12 098 000	USD	9 563 643	9 007 924	0,37

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.125% 20 - 28.02.25	3 870 000	USD	3 479 592	3 364 332	0,14
United States 1.125% 20 - 28.02.27	1 921 000	USD	1 709 940	1 593 370	0,07
United States 1.125% 20 - 15.08.40	5 739 000	USD	3 982 728	3 323 375	0,14
United States 1.125% 21 - 15.02.31	11 562 000	USD	9 203 924	8 744 570	0,36
United States 1.125% 21 - 29.02.28	6 872 000	USD	5 821 136	5 563 884	0,23
United States 1.125% 21 - 31.10.26	6 221 000	USD	5 442 150	5 196 955	0,21
United States 1.125% 22 - 15.01.25	5 637 000	USD	5 087 976	4 916 396	0,20
United States 1.25% 20 - 15.05.50	6 357 000	USD	4 360 497	3 116 564	0,13
United States 1.25% 21 - 31.03.28	6 130 000	USD	5 188 090	4 977 000	0,20
United States 1.25% 21 - 30.06.28	6 380 000	USD	5 448 622	5 152 904	0,21
United States 1.25% 21 - 15.08.31	13 148 000	USD	10 611 656	9 864 123	0,40
United States 1.375% 19 - 31.08.26	2 893 000	USD	2 578 931	2 441 333	0,10
United States 1.375% 20 - 31.01.25	3 475 000	USD	3 150 079	3 035 198	0,12
United States 1.375% 20 - 15.08.50	7 399 000	USD	5 003 090	3 749 861	0,15
United States 1.375% 20 - 15.11.40	6 360 000	USD	4 563 211	3 831 423	0,16
United States 1.375% 21 - 31.10.28	6 390 000	USD	5 507 603	5 151 039	0,21
United States 1.375% 21 - 15.11.31	12 227 000	USD	10 203 444	9 202 555	0,38
United States 1.50% 16 - 15.08.26	6 141 000	USD	5 398 101	5 203 088	0,21
United States 1.50% 20 - 31.01.27	8 459 000	USD	7 439 686	7 109 629	0,29
United States 1.50% 20 - 15.02.30	6 562 000	USD	5 739 648	5 179 236	0,21
United States 1.50% 21 - 30.11.28	6 417 000	USD	5 588 408	5 195 495	0,21
United States 1.50% 22 - 15.02.25	5 180 000	USD	4 681 627	4 525 143	0,19
United States 1.625% 16 - 15.02.26	5 814 000	USD	5 187 184	4 988 531	0,20
United States 1.625% 16 - 15.05.26	5 515 000	USD	4 854 932	4 710 921	0,19
United States 1.625% 19 - 15.08.29	5 073 000	USD	4 414 077	4 090 110	0,17
United States 1.625% 19 - 30.09.26	1 987 000	USD	1 754 628	1 686 899	0,07
United States 1.625% 19 - 31.10.26	2 939 200	USD	2 635 241	2 491 129	0,10
United States 1.625% 19 - 30.11.26	2 188 000	USD	1 960 029	1 851 352	0,08
United States 1.625% 20 - 15.11.50	7 656 000	USD	5 235 514	4 147 591	0,17
United States 1.625% 21 - 15.05.31	11 420 000	USD	9 566 859	8 877 856	0,36
United States 1.75% 19 - 15.11.29	3 661 000	USD	3 211 320	2 959 969	0,12
United States 1.75% 19 - 31.12.24	3 473 000	USD	3 132 871	3 051 136	0,12
United States 1.75% 19 - 31.12.26	2 715 000	USD	2 410 259	2 303 412	0,09
United States 1.75% 22 - 15.03.25	5 573 000	USD	5 024 796	4 874 766	0,20
United States 1.875% 19 - 30.06.26	2 634 000	USD	2 324 361	2 260 771	0,09
United States 1.875% 19 - 31.07.26	2 684 000	USD	2 389 776	2 298 371	0,09
United States 1.875% 21 - 15.02.51	8 264 000	USD	5 600 207	4 766 864	0,20
United States 1.875% 21 - 15.02.41	7 245 000	USD	5 493 361	4 728 368	0,19
United States 1.875% 21 - 15.11.51	7 907 000	USD	5 620 693	4 546 399	0,19
United States 1.875% 22 - 15.02.32	11 604 000	USD	9 868 703	9 042 234	0,37
United States 2.00% 15 - 15.02.25	5 933 000	USD	5 375 497	5 211 482	0,21
United States 2.00% 15 - 15.08.25	6 144 000	USD	5 507 987	5 352 500	0,22
United States 2.00% 16 - 15.11.26	5 724 000	USD	5 023 115	4 899 975	0,20
United States 2.00% 20 - 15.02.50	5 546 000	USD	4 515 233	3 316 730	0,14
United States 2.00% 21 - 15.08.51	7 925 000	USD	5 594 755	4 705 838	0,19
United States 2.00% 21 - 15.11.41	6 931 000	USD	5 279 251	4 553 831	0,19
United States 2.125% 15 - 15.05.25	6 046 000	USD	5 463 994	5 297 912	0,22
United States 2.125% 19 - 31.05.26	2 802 000	USD	2 468 242	2 422 405	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.25% 15 - 15.11.25	6 473 000	USD	5 762 240	5 643 695	0,23
United States 2.25% 16 - 15.08.46	3 545 000	USD	2 715 024	2 288 533	0,09
United States 2.25% 17 - 15.02.27	4 970 000	USD	4 448 827	4 271 392	0,17
United States 2.25% 17 - 15.08.27	5 062 000	USD	4 441 585	4 321 820	0,18
United States 2.25% 17 - 15.11.27	5 048 000	USD	4 404 908	4 297 729	0,18
United States 2.25% 18 - 31.12.24	2 644 000	USD	2 408 790	2 334 428	0,10
United States 2.25% 19 - 31.03.26	2 814 000	USD	2 552 305	2 443 924	0,10
United States 2.25% 19 - 15.08.49	5 090 000	USD	3 877 612	3 231 215	0,13
United States 2.25% 22 - 15.02.52	6 956 000	USD	5 403 760	4 384 298	0,18
United States 2.375% 17 - 15.05.27	6 150 000	USD	5 475 339	5 288 135	0,22
United States 2.375% 19 - 30.04.26	2 397 000	USD	2 179 002	2 085 155	0,09
United States 2.375% 19 - 15.05.29	5 659 000	USD	5 081 563	4 753 080	0,19
United States 2.375% 19 - 15.11.49	4 574 000	USD	3 376 522	2 982 582	0,12
United States 2.375% 21 - 15.05.51	8 477 000	USD	6 655 186	5 501 243	0,23
United States 2.50% 15 - 15.02.45	3 968 000	USD	3 049 295	2 727 741	0,11
United States 2.50% 16 - 15.02.46	2 733 000	USD	2 127 125	1 861 750	0,08
United States 2.50% 16 - 15.05.46	2 796 000	USD	2 188 207	1 900 712	0,08
United States 2.50% 18 - 31.01.25	3 024 000	USD	2 716 536	2 673 358	0,11
United States 2.50% 19 - 28.02.26	3 003 000	USD	2 683 689	2 623 785	0,11
United States 2.625% 18 - 31.03.25	2 133 000	USD	1 912 263	1 885 069	0,08
United States 2.625% 18 - 31.12.25	2 403 000	USD	2 125 401	2 108 390	0,09
United States 2.625% 19 - 31.01.26	3 095 000	USD	2 827 316	2 713 798	0,11
United States 2.625% 19 - 15.02.29	6 396 000	USD	5 771 129	5 455 330	0,22
United States 2.625% 22 - 15.04.25	5 190 000	USD	4 825 741	4 582 330	0,19
United States 2.625% 22 - 31.05.27	5 226 000	USD	4 841 533	4 529 846	0,19
United States 2.625% 22 - 31.07.29	4 029 000	USD	3 609 005	3 419 352	0,14
United States 2.75% 12 - 15.08.42	1 466 800	USD	1 246 028	1 079 494	0,04
United States 2.75% 12 - 15.11.42	2 315 000	USD	1 885 792	1 698 816	0,07
United States 2.75% 17 - 15.08.47	3 431 000	USD	2 988 561	2 427 988	0,10
United States 2.75% 17 - 15.11.47	3 941 000	USD	3 074 240	2 787 223	0,11
United States 2.75% 18 - 15.02.28	6 834 000	USD	6 186 193	5 913 978	0,24
United States 2.75% 18 - 28.02.25	2 875 000	USD	2 519 316	2 546 515	0,10
United States 2.75% 18 - 30.06.25	1 892 000	USD	1 683 935	1 671 011	0,07
United States 2.75% 18 - 31.08.25	2 231 000	USD	2 043 060	1 965 997	0,08
United States 2.75% 22 - 15.05.25	5 241 000	USD	4 793 701	4 631 066	0,19
United States 2.75% 22 - 31.05.29	4 498 000	USD	4 114 612	3 847 924	0,16
United States 2.75% 22 - 15.08.32	10 770 000	USD	9 724 305	8 942 297	0,37
United States 2.875% 13 - 15.05.43	3 262 000	USD	2 668 283	2 430 664	0,10
United States 2.875% 15 - 15.08.45	2 351 000	USD	2 071 331	1 721 243	0,07
United States 2.875% 16 - 15.11.46	1 455 000	USD	1 264 402	1 057 843	0,04
United States 2.875% 18 - 30.04.25	2 918 000	USD	2 641 161	2 583 364	0,11
United States 2.875% 18 - 15.05.28	7 504 000	USD	6 706 912	6 517 131	0,27
United States 2.875% 18 - 31.05.25	2 412 000	USD	2 157 062	2 133 686	0,09
United States 2.875% 18 - 31.07.25	2 194 000	USD	2 025 096	1 938 668	0,08
United States 2.875% 18 - 15.08.28	7 236 000	USD	6 539 061	6 270 047	0,26
United States 2.875% 18 - 30.11.25	2 748 000	USD	2 483 907	2 423 530	0,10
United States 2.875% 19 - 15.05.49	5 342 000	USD	4 637 952	3 858 914	0,16
United States 2.875% 22 - 15.05.32	11 323 000	USD	10 283 825	9 513 564	0,39

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.875% 22 - 15.05.52	6 500 000	USD	5 461 237	4 705 534	0,19
United States 2.875% 22 - 15.06.25	4 708 000	USD	4 365 612	4 165 423	0,17
United States 3.00% 12 - 15.05.42	1 834 000	USD	1 633 680	1 408 622	0,06
United States 3.00% 14 - 15.11.44	2 858 000	USD	2 587 969	2 147 413	0,09
United States 3.00% 15 - 15.05.45	1 687 000	USD	1 489 897	1 263 265	0,05
United States 3.00% 15 - 15.11.45	1 699 000	USD	1 394 796	1 268 886	0,05
United States 3.00% 17 - 15.02.47	3 678 000	USD	3 092 070	2 730 760	0,11
United States 3.00% 17 - 15.05.47	2 308 200	USD	2 230 087	1 712 762	0,07
United States 3.00% 18 - 15.02.48	4 179 000	USD	3 697 805	3 093 865	0,13
United States 3.00% 18 - 15.08.48	4 900 000	USD	4 372 847	3 624 875	0,15
United States 3.00% 18 - 30.09.25	2 465 000	USD	2 228 376	2 180 221	0,09
United States 3.00% 18 - 31.10.25	2 153 000	USD	1 923 714	1 903 658	0,08
United States 3.00% 19 - 15.02.49	5 231 000	USD	4 684 393	3 868 259	0,16
United States 3.00% 22 - 15.07.25	4 785 000	USD	4 548 712	4 236 933	0,17
United States 3.00% 22 - 15.08.52	6 572 000	USD	5 477 396	4 885 941	0,20
United States 3.125% 11 - 15.11.41	1 664 000	USD	1 506 001	1 313 357	0,05
United States 3.125% 12 - 15.02.42	1 832 000	USD	1 651 684	1 441 032	0,06
United States 3.125% 13 - 15.02.43	2 391 000	USD	2 034 318	1 855 032	0,08
United States 3.125% 14 - 15.08.44	2 989 000	USD	2 669 511	2 296 577	0,09
United States 3.125% 18 - 15.05.48	4 478 000	USD	4 058 699	3 389 334	0,14
United States 3.125% 18 - 15.11.28	7 013 000	USD	6 455 664	6 136 335	0,25
United States 3.125% 22 - 15.08.25	4 668 000	USD	4 448 393	4 141 257	0,17
United States 3.125% 22 - 31.08.27	5 009 000	USD	4 612 145	4 408 353	0,18
United States 3.125% 22 - 31.08.29	4 179 000	USD	3 897 445	3 637 685	0,15
United States 3.25% 22 - 30.06.27	5 333 000	USD	5 089 449	4 719 148	0,19
United States 3.25% 22 - 30.06.29	4 654 000	USD	4 419 055	4 082 097	0,17
United States 3.375% 14 - 15.05.44	2 347 000	USD	2 171 836	1 877 664	0,08
United States 3.375% 18 - 15.11.48	4 994 000	USD	4 684 446	3 954 365	0,16
United States 3.375% 22 - 15.08.42	4 143 000	USD	3 683 445	3 355 533	0,14
United States 3.375% 23 - 15.05.33	11 019 000	USD	9 730 008	9 588 569	0,39
United States 3.50% 09 - 15.02.39	745 000	USD	659 734	639 541	0,03
United States 3.50% 22 - 15.09.25	4 532 000	USD	4 481 280	4 042 399	0,17
United States 3.50% 23 - 31.01.28	4 780 000	USD	4 339 675	4 261 579	0,17
United States 3.50% 23 - 31.01.30	3 773 000	USD	3 414 539	3 344 048	0,14
United States 3.50% 23 - 15.02.33	11 006 000	USD	9 947 772	9 675 333	0,40
United States 3.50% 23 - 30.04.30	3 880 000	USD	3 560 611	3 436 139	0,14
United States 3.625% 13 - 15.08.43	2 500 000	USD	2 310 663	2 086 351	0,09
United States 3.625% 14 - 15.02.44	2 832 000	USD	2 771 925	2 355 406	0,10
United States 3.625% 23 - 15.02.53	6 343 000	USD	5 585 805	5 324 891	0,22
United States 3.625% 23 - 31.03.28	4 668 000	USD	4 233 005	4 180 874	0,17
United States 3.625% 23 - 31.03.30	3 983 000	USD	3 585 864	3 553 272	0,15
United States 3.625% 23 - 15.05.26	4 450 000	USD	4 096 704	3 982 476	0,16
United States 3.625% 23 - 15.05.53	6 655 000	USD	5 730 074	5 594 343	0,23
United States 3.625% 23 - 31.05.28	4 610 000	USD	4 249 781	4 131 534	0,17
United States 3.75% 11 - 15.08.41	1 459 000	USD	1 467 855	1 259 694	0,05
United States 3.75% 13 - 15.11.43	2 320 000	USD	2 271 438	1 966 980	0,08
United States 3.75% 23 - 15.04.26	4 648 000	USD	4 217 971	4 169 535	0,17
United States 3.75% 23 - 31.05.30	3 760 000	USD	3 391 890	3 377 201	0,14

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.875% 10 - 15.08.40	1 240 000	USD	1 249 768	1 096 920	0,04
United States 3.875% 22 - 30.09.29	4 026 000	USD	3 864 029	3 640 606	0,15
United States 3.875% 22 - 30.11.27	4 627 000	USD	4 418 534	4 181 457	0,17
United States 3.875% 23 - 31.12.27	4 712 000	USD	4 364 499	4 260 938	0,17
United States 3.875% 23 - 31.12.29	3 792 000	USD	3 508 066	3 430 079	0,14
United States 3.875% 23 - 15.01.26	4 485 000	USD	4 120 639	4 029 658	0,16
United States 3.875% 23 - 30.04.25	4 673 000	USD	4 315 593	4 192 623	0,17
United States 3.875% 23 - 15.05.43	4 240 000	USD	3 751 443	3 672 192	0,15
United States 3.875% 23 - 15.08.33	12 256 000	USD	10 921 562	11 098 383	0,45
United States 4.00% 22 - 31.10.29	3 880 000	USD	3 736 129	3 532 182	0,14
United States 4.00% 22 - 15.11.52	6 333 000	USD	5 998 589	5 679 290	0,23
United States 4.00% 22 - 15.11.42	4 558 000	USD	4 246 344	4 023 038	0,16
United States 4.00% 22 - 15.12.25	4 852 000	USD	4 508 974	4 369 693	0,18
United States 4.00% 23 - 15.02.26	4 450 000	USD	4 133 931	4 010 800	0,16
United States 4.00% 23 - 28.02.30	3 904 000	USD	3 635 985	3 555 135	0,15
United States 4.00% 23 - 30.06.28	4 946 000	USD	4 480 460	4 500 522	0,18
United States 4.00% 23 - 31.07.30	4 093 000	USD	3 730 558	3 728 982	0,15
United States 4.125% 22 - 30.09.27	4 683 000	USD	4 595 286	4 268 497	0,17
United States 4.125% 22 - 31.10.27	4 805 000	USD	4 633 196	4 379 019	0,18
United States 4.125% 22 - 15.11.32	11 008 000	USD	10 533 904	10 144 208	0,42
United States 4.125% 23 - 31.01.25	3 500 000	USD	3 209 125	3 149 116	0,13
United States 4.125% 23 - 15.06.26	4 040 000	USD	3 669 713	3 657 267	0,15
United States 4.125% 23 - 31.07.28	4 783 000	USD	4 344 163	4 376 559	0,18
United States 4.125% 23 - 15.08.53	7 050 000	USD	6 104 262	6 479 837	0,27
United States 4.125% 23 - 31.08.30	4 409 000	USD	4 043 189	4 046 189	0,17
United States 4.25% 09 - 15.05.39	1 331 000	USD	1 333 884	1 243 501	0,05
United States 4.25% 10 - 15.11.40	1 436 000	USD	1 477 878	1 327 583	0,05
United States 4.25% 22 - 15.10.25	4 448 000	USD	4 345 240	4 019 693	0,16
United States 4.25% 23 - 31.05.25	4 666 000	USD	4 331 187	4 208 122	0,17
United States 4.375% 08 - 15.02.38	766 000	USD	771 836	729 837	0,03
United States 4.375% 09 - 15.11.39	1 425 000	USD	1 471 804	1 346 439	0,06
United States 4.375% 10 - 15.05.40	1 533 000	USD	1 617 828	1 444 148	0,06
United States 4.375% 11 - 15.05.41	1 267 000	USD	1 313 542	1 185 321	0,05
United States 4.375% 23 - 15.08.26	4 670 000	USD	4 276 944	4 257 969	0,17
United States 4.375% 23 - 31.08.28	4 900 000	USD	4 567 853	4 532 827	0,19
United States 4.375% 23 - 15.08.43	4 697 000	USD	4 129 350	4 355 004	0,18
United States 4.375% 23 - 30.11.28	5 600 000	USD	5 163 113	5 192 651	0,21
United States 4.375% 23 - 30.11.30	4 100 000	USD	3 805 232	3 822 350	0,16
United States 4.375% 23 - 15.12.26	5 000 000	USD	4 546 609	4 572 644	0,19
United States 4.50% 06 - 15.02.36	861 900	USD	905 687	833 401	0,03
United States 4.50% 08 - 15.05.38	935 500	USD	953 949	901 127	0,04
United States 4.50% 09 - 15.08.39	1 381 000	USD	1 532 441	1 325 570	0,05
United States 4.50% 22 - 15.11.25	4 425 000	USD	4 241 215	4 019 563	0,16
United States 4.50% 23 - 15.07.26	4 050 000	USD	3 674 683	3 701 837	0,15
United States 4.50% 23 - 30.09.30	4 020 000	USD	3 739 900	3 797 806	0,16
United States 4.50% 24 - 15.11.33	8 232 000	USD	7 722 803	7 836 384	0,32
United States 4.625% 10 - 15.02.40	1 477 000	USD	1 639 675	1 434 013	0,06
United States 4.625% 23 - 28.02.25	4 900 000	USD	4 591 215	4 432 328	0,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.625% 23 - 15.03.26	4 745 000	USD	4 421 598	4 333 734	0,18
United States 4.625% 23 - 15.09.26	4 890 000	USD	4 574 965	4 488 992	0,18
United States 4.625% 23 - 15.10.26	4 917 000	USD	4 605 749	4 518 646	0,19
United States 4.625% 23 - 15.11.26	5 262 000	USD	4 850 187	4 840 162	0,20
United States 4.75% 11 - 15.02.41	1 615 000	USD	1 702 320	1 584 444	0,06
United States 4.75% 23 - 31.07.25	4 822 000	USD	4 386 718	4 385 645	0,18
United States 4.75% 23 - 15.11.43	1 800 000	USD	1 661 016	1 753 468	0,07
United States 4.75% 24 - 15.11.53	4 690 000	USD	4 592 210	4 782 369	0,20
United States 4.875% 23 - 31.10.28	5 704 000	USD	5 399 601	5 392 762	0,22
United States 4.875% 23 - 31.10.30	4 230 000	USD	3 998 597	4 055 433	0,17
United States 4.875% 23 - 30.11.25	5 920 000	USD	5 384 435	5 415 895	0,22
United States 5.00% 07 - 15.05.37	672 000	USD	730 511	681 148	0,03
United States 5.00% 23 - 31.08.25	5 035 000	USD	4 727 927	4 600 736	0,19
United States 5.00% 23 - 31.10.25	5 726 000	USD	5 391 953	5 243 476	0,21
United States 5.25% 98 - 15.11.28	798 000	USD	794 617	764 616	0,03
United States 5.375% 01 - 15.02.31	856 000	USD	921 363	847 553	0,03
United States 6.00% 96 - 15.02.26	583 000	USD	558 945	544 427	0,02
United States 6.125% 97 - 15.11.27	749 000	USD	764 891	729 532	0,03
United States 6.25% 00 - 15.05.30	1 102 000	USD	1 158 251	1 126 510	0,05
			1 167 441 870	1 100 636 423	45,07
Total - Obligations			2 606 511 302	2 426 209 723	99,36
Fonds communs de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Dollar Fund-Z-	0	USD	31	30	0,00
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	377	EUR	3 786 611	3 788 708	0,15
			3 786 642	3 788 738	0,15
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			3 786 642	3 788 738	0,15
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			2 610 297 944	2 429 998 461	99,51
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			2 610 297 944	2 429 998 461	99,51
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				2 447 435 808	100,23

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

Xtrackers II

Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en SGD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 21 - 01.07.31	5 074 000	SGD	4 947 007	4 694 465	3,95
Singapore Zero Coupon 21 - 01.11.26	5 792 000	SGD	5 659 349	5 527 885	4,65
Singapore 0.50% 20 - 01.11.25	6 900 000	SGD	6 737 265	6 562 590	5,52
Singapore 1.875% 20 - 01.03.50	6 079 000	SGD	6 264 388	5 108 184	4,30
Singapore 1.875% 21 - 01.10.51	5 430 000	SGD	4 628 611	4 557 399	3,83
Singapore 2.125% 16 - 01.06.26	7 059 000	SGD	7 116 009	6 901 584	5,81
Singapore 2.25% 16 - 01.08.36	7 625 000	SGD	7 699 930	7 230 025	6,08
Singapore 2.375% 15 - 01.06.25	9 318 000	SGD	9 340 509	9 177 298	7,72
Singapore 2.375% 19 - 01.07.39	4 084 000	SGD	4 253 769	3 883 476	3,27
Singapore 2.625% 18 - 01.05.28	6 319 000	SGD	6 388 441	6 306 994	5,31
Singapore 2.625% 22 - 01.08.32	5 072 000	SGD	4 863 781	5 033 960	4,24
Singapore 2.75% 12 - 01.04.42	5 981 000	SGD	6 253 543	5 969 038	5,02
Singapore 2.75% 16 - 01.03.46	6 154 000	SGD	6 434 064	6 127 538	5,16
Singapore 2.875% 10 - 01.09.30	7 884 000	SGD	8 339 733	7 941 553	6,68
Singapore 2.875% 14 - 01.07.29	6 244 000	SGD	6 558 270	6 287 708	5,29
Singapore 2.875% 22 - 01.09.27	2 464 000	SGD	2 412 971	2 476 566	2,08
Singapore 2.875% 23 - 01.08.28	2 008 000	SGD	1 988 433	2 025 068	1,70
Singapore 3.00% 22 - 01.08.72	4 712 000	SGD	4 744 405	5 040 426	4,24
Singapore 3.375% 13 - 01.09.33	7 782 000	SGD	7 812 399	8 220 905	6,92
Singapore 3.50% 07 - 01.03.27	8 700 000	SGD	9 032 015	8 859 210	7,45
			121 974 892	117 931 872	99,22
Total - Obligations			121 974 892	117 931 872	99,22
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			121 974 892	117 931 872	99,22
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			121 974 892	117 931 872	99,22
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				118 849 984	100,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 20 - 15.05.40	13 260 000	USD	9 604 615	8 564 986	0,27
United States Zero Coupon 20 - 30.06.27	10 080 000	USD	9 154 165	8 954 639	0,29
United States Zero Coupon 20 - 31.10.25	13 787 000	USD	13 051 790	12 805 743	0,41
United States Zero Coupon 20 - 31.10.27	13 105 000	USD	11 927 239	11 519 121	0,37
United States Zero Coupon 21 - 31.01.26	15 059 000	USD	14 116 554	13 910 751	0,45
United States Zero Coupon 21 - 31.03.26	15 200 000	USD	14 371 879	14 100 423	0,45
United States Zero Coupon 21 - 30.04.26	15 030 000	USD	14 141 687	13 907 423	0,45
United States Zero Coupon 21 - 30.04.28	14 989 000	USD	13 846 866	13 418 656	0,43
United States Zero Coupon 21 - 31.05.28	16 272 000	USD	14 837 636	14 534 214	0,47
United States Zero Coupon 21 - 15.05.41	18 630 000	USD	15 510 855	14 227 018	0,46
United States Zero Coupon 21 - 30.06.26	15 533 000	USD	14 651 194	14 368 001	0,46
United States Zero Coupon 21 - 31.07.26	15 191 000	USD	14 186 304	13 915 181	0,45
United States Zero Coupon 21 - 31.07.28	15 036 000	USD	13 592 763	13 226 934	0,42
United States Zero Coupon 21 - 31.08.28	15 474 000	USD	14 133 356	13 664 255	0,44
United States Zero Coupon 21 - 15.08.41	18 481 000	USD	14 301 174	12 887 379	0,41
United States Zero Coupon 21 - 30.09.26	15 192 000	USD	14 178 942	13 957 626	0,45
United States Zero Coupon 21 - 30.09.28	15 573 000	USD	14 174 184	13 802 776	0,44
United States Zero Coupon 21 - 30.11.26	14 670 000	USD	13 788 050	13 567 435	0,43
United States Zero Coupon 21 - 31.12.26	14 374 000	USD	13 509 028	13 266 775	0,42
United States Zero Coupon 21 - 31.12.28	13 124 000	USD	11 866 121	11 642 454	0,37
United States Zero Coupon 22 - 31.01.29	13 427 000	USD	12 364 937	12 111 616	0,39
United States Zero Coupon 22 - 28.02.27	12 845 000	USD	12 211 888	12 039 227	0,39
United States Zero Coupon 22 - 28.02.29	12 557 000	USD	11 711 028	11 383 745	0,36
United States Zero Coupon 22 - 15.02.42	12 366 000	USD	10 195 688	9 512 062	0,30
United States Zero Coupon 22 - 31.03.27	12 794 000	USD	12 346 473	12 229 255	0,39
United States Zero Coupon 22 - 31.03.29	12 373 000	USD	11 614 194	11 487 576	0,37
United States Zero Coupon 22 - 30.04.27	12 296 000	USD	11 886 212	11 830 107	0,38
United States Zero Coupon 22 - 30.04.29	10 588 000	USD	10 233 271	10 071 868	0,32
United States Zero Coupon 22 - 15.05.42	11 356 000	USD	10 236 597	9 986 990	0,32
United States Zero Coupon 22 - 31.07.27	11 600 000	USD	11 142 284	11 136 915	0,36
United States Zero Coupon 22 - 30.11.29	8 691 000	USD	8 678 751	8 678 778	0,28
United States Zero Coupon 23 - 31.12.24	10 444 000	USD	10 417 140	10 388 500	0,33
United States Zero Coupon 23 - 29.02.28	10 919 000	USD	10 840 367	10 955 672	0,35
United States Zero Coupon 23 - 15.02.43	9 575 000	USD	9 300 848	9 144 881	0,29
United States Zero Coupon 23 - 31.03.25	9 263 000	USD	9 217 015	9 181 934	0,29
United States Zero Coupon 23 - 30.04.28	10 801 000	USD	10 633 793	10 631 399	0,34
United States Zero Coupon 23 - 30.06.25	10 187 000	USD	10 151 701	10 211 664	0,33
United States Zero Coupon 23 - 30.06.30	8 851 000	USD	8 707 618	8 774 937	0,28
United States Zero Coupon 23 - 30.09.25	11 927 000	USD	11 921 287	12 049 997	0,39
United States Zero Coupon 23 - 30.09.28	12 346 000	USD	12 270 567	12 744 361	0,41
United States 0.25% 20 - 31.05.25	11 440 000	USD	10 985 318	10 774 147	0,34
United States 0.25% 20 - 30.06.25	11 725 000	USD	11 152 374	11 012 340	0,35
United States 0.25% 20 - 31.07.25	12 175 000	USD	11 551 117	11 401 688	0,37
United States 0.25% 20 - 31.08.25	12 868 000	USD	12 240 251	12 014 480	0,38
United States 0.25% 20 - 30.09.25	13 212 000	USD	12 439 476	12 303 675	0,39
United States 0.375% 20 - 30.04.25	10 329 000	USD	9 914 840	9 773 816	0,31
United States 0.375% 20 - 31.07.27	10 936 000	USD	9 920 987	9 643 356	0,31
United States 0.375% 20 - 30.09.27	12 175 000	USD	10 978 852	10 678 797	0,34

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.375% 20 - 30.11.25	14 142 000	USD	13 432 952	13 133 267	0,42
United States 0.375% 20 - 31.12.25	14 854 000	USD	13 976 256	13 764 332	0,44
United States 0.50% 20 - 31.03.25	10 630 000	USD	10 250 538	10 107 610	0,32
United States 0.50% 20 - 30.04.27	8 301 000	USD	7 606 761	7 409 952	0,24
United States 0.50% 20 - 31.05.27	9 013 000	USD	8 199 371	8 026 492	0,26
United States 0.50% 20 - 31.08.27	11 547 000	USD	10 478 948	10 201 946	0,33
United States 0.50% 21 - 28.02.26	15 161 000	USD	14 276 277	14 007 366	0,45
United States 0.625% 20 - 31.03.27	7 590 000	USD	7 078 351	6 822 100	0,22
United States 0.625% 20 - 15.05.30	22 260 000	USD	18 952 087	18 197 550	0,58
United States 0.625% 20 - 15.08.30	26 842 100	USD	22 957 527	21 773 661	0,70
United States 0.625% 20 - 30.11.27	14 098 000	USD	12 790 757	12 427 112	0,40
United States 0.625% 20 - 31.12.27	14 376 000	USD	12 974 708	12 639 649	0,40
United States 0.75% 21 - 31.01.28	15 393 000	USD	13 951 123	13 572 273	0,43
United States 0.75% 21 - 31.05.26	14 828 000	USD	13 895 932	13 688 098	0,44
United States 0.75% 21 - 31.08.26	15 191 000	USD	14 255 640	13 930 598	0,45
United States 0.875% 20 - 15.11.30	28 166 000	USD	24 550 113	23 148 887	0,74
United States 1.125% 20 - 28.02.25	10 166 000	USD	9 856 690	9 765 682	0,31
United States 1.125% 20 - 28.02.27	7 590 000	USD	7 145 434	6 951 966	0,22
United States 1.125% 20 - 15.08.40	17 013 400	USD	12 111 802	10 881 784	0,35
United States 1.125% 21 - 15.02.31	29 098 000	USD	25 328 537	24 287 782	0,78
United States 1.125% 21 - 29.02.28	15 042 000	USD	13 744 337	13 446 138	0,43
United States 1.125% 21 - 31.10.26	15 065 000	USD	14 161 995	13 905 642	0,45
United States 1.125% 22 - 15.01.25	12 497 000	USD	12 171 805	12 038 126	0,39
United States 1.25% 20 - 15.05.50	9 725 000	USD	6 444 248	5 253 772	0,17
United States 1.25% 21 - 31.03.28	15 476 000	USD	14 218 241	13 877 619	0,44
United States 1.25% 21 - 30.06.28	15 589 800	USD	14 315 844	13 906 564	0,45
United States 1.25% 21 - 15.08.31	19 420 000	USD	16 870 280	16 070 171	0,51
United States 1.375% 19 - 31.08.26	7 590 000	USD	7 289 734	7 076 477	0,23
United States 1.375% 20 - 31.01.25	9 044 800	USD	8 841 720	8 726 119	0,28
United States 1.375% 20 - 15.08.50	17 512 000	USD	11 377 083	9 777 976	0,31
United States 1.375% 20 - 15.11.40	19 005 700	USD	13 706 953	12 628 382	0,40
United States 1.375% 21 - 31.10.28	15 130 000	USD	13 802 202	13 465 700	0,43
United States 1.375% 21 - 15.11.31	27 162 000	USD	23 667 171	22 553 076	0,72
United States 1.50% 16 - 15.08.26	15 328 600	USD	14 523 841	14 348 959	0,46
United States 1.50% 20 - 31.01.27	14 387 000	USD	13 613 460	13 354 115	0,43
United States 1.50% 20 - 15.02.30	18 714 000	USD	16 834 969	16 310 391	0,52
United States 1.50% 21 - 30.11.28	15 396 000	USD	14 050 611	13 764 986	0,44
United States 1.50% 22 - 15.02.25	12 174 000	USD	11 880 266	11 746 027	0,38
United States 1.625% 16 - 15.02.26	15 613 800	USD	15 019 840	14 795 308	0,47
United States 1.625% 16 - 15.05.26	15 764 000	USD	15 171 296	14 872 373	0,48
United States 1.625% 19 - 15.08.29	17 931 000	USD	16 556 060	15 958 618	0,51
United States 1.625% 19 - 30.09.26	8 294 000	USD	7 952 750	7 779 487	0,25
United States 1.625% 19 - 31.10.26	8 376 000	USD	7 946 618	7 843 960	0,25
United States 1.625% 19 - 30.11.26	8 044 000	USD	7 653 232	7 519 248	0,24
United States 1.625% 20 - 15.11.50	18 514 000	USD	12 818 837	11 054 868	0,35
United States 1.625% 21 - 15.05.31	29 905 000	USD	26 512 571	25 648 350	0,82
United States 1.75% 19 - 15.11.29	18 680 000	USD	17 260 309	16 677 737	0,53
United States 1.75% 19 - 31.12.24	9 233 000	USD	9 053 031	8 961 038	0,29

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.75% 19 - 31.12.26	7 978 000	USD	7 578 536	7 472 538	0,24
United States 1.75% 22 - 15.03.25	11 942 000	USD	11 640 792	11 537 110	0,37
United States 1.875% 19 - 30.06.26	7 964 000	USD	7 634 374	7 553 960	0,24
United States 1.875% 19 - 31.07.26	7 590 000	USD	7 335 379	7 180 265	0,23
United States 1.875% 21 - 15.02.51	18 758 000	USD	13 558 878	11 923 083	0,38
United States 1.875% 21 - 15.02.41	18 333 000	USD	14 371 752	13 203 928	0,42
United States 1.875% 21 - 15.11.51	22 973 000	USD	16 297 778	14 557 362	0,47
United States 1.875% 22 - 15.02.32	25 926 000	USD	22 937 603	22 300 451	0,71
United States 2.00% 15 - 15.02.25	16 394 300	USD	16 130 379	15 912 692	0,51
United States 2.00% 15 - 15.08.25	16 311 200	USD	15 933 522	15 696 956	0,50
United States 2.00% 16 - 15.11.26	15 706 000	USD	15 081 733	14 850 722	0,48
United States 2.00% 20 - 15.02.50	12 307 000	USD	9 435 937	8 113 957	0,26
United States 2.00% 21 - 15.08.51	18 805 000	USD	14 594 182	12 302 613	0,39
United States 2.00% 21 - 15.11.41	15 773 000	USD	12 427 139	11 435 326	0,37
United States 2.125% 15 - 15.05.25	16 312 200	USD	16 011 068	15 790 936	0,51
United States 2.125% 19 - 31.05.26	7 590 000	USD	7 456 447	7 246 665	0,23
United States 2.25% 15 - 15.11.25	16 357 100	USD	15 960 624	15 753 932	0,50
United States 2.25% 16 - 15.08.46	9 249 600	USD	7 476 923	6 585 260	0,21
United States 2.25% 17 - 15.02.27	15 304 000	USD	14 776 859	14 526 844	0,47
United States 2.25% 17 - 15.08.27	16 455 000	USD	15 785 800	15 517 823	0,50
United States 2.25% 17 - 15.11.27	15 606 000	USD	14 958 062	14 672 078	0,47
United States 2.25% 18 - 31.12.24	6 641 000	USD	6 572 391	6 476 526	0,21
United States 2.25% 19 - 31.03.26	7 590 000	USD	7 450 272	7 280 482	0,23
United States 2.25% 19 - 15.08.49	13 204 900	USD	10 397 261	9 237 240	0,30
United States 2.25% 22 - 15.02.52	15 811 000	USD	12 513 631	10 980 060	0,35
United States 2.375% 17 - 15.05.27	15 443 000	USD	14 980 644	14 664 830	0,47
United States 2.375% 19 - 30.04.26	7 967 000	USD	7 814 481	7 655 777	0,25
United States 2.375% 19 - 15.05.29	18 487 000	USD	17 628 970	17 139 514	0,55
United States 2.375% 19 - 15.11.49	12 657 000	USD	10 441 199	9 095 281	0,29
United States 2.375% 21 - 15.05.51	18 874 000	USD	14 834 092	13 489 130	0,43
United States 2.50% 15 - 15.02.45	10 549 800	USD	8 891 557	7 999 666	0,26
United States 2.50% 16 - 15.02.46	9 149 900	USD	7 466 534	6 878 066	0,22
United States 2.50% 16 - 15.05.46	9 907 700	USD	8 317 014	7 427 632	0,24
United States 2.50% 18 - 31.01.25	6 641 000	USD	6 571 357	6 485 341	0,21
United States 2.50% 19 - 28.02.26	7 915 000	USD	7 723 096	7 637 975	0,24
United States 2.625% 18 - 31.03.25	7 101 000	USD	7 012 043	6 931 253	0,22
United States 2.625% 18 - 31.12.25	7 498 000	USD	7 353 681	7 266 611	0,23
United States 2.625% 19 - 31.01.26	7 590 000	USD	7 460 402	7 349 865	0,24
United States 2.625% 19 - 15.02.29	18 456 000	USD	17 841 924	17 376 108	0,56
United States 2.625% 22 - 15.04.25	11 457 000	USD	11 245 391	11 175 928	0,36
United States 2.625% 22 - 31.05.27	12 157 000	USD	11 759 560	11 637 469	0,37
United States 2.625% 22 - 31.07.29	9 671 000	USD	9 098 177	9 057 511	0,29
United States 2.75% 12 - 15.08.42	10 611 700	USD	9 555 128	8 624 352	0,28
United States 2.75% 12 - 15.11.42	10 110 000	USD	9 041 452	8 188 989	0,26
United States 2.75% 17 - 15.08.47	9 563 000	USD	8 427 708	7 462 868	0,24
United States 2.75% 17 - 15.11.47	9 599 000	USD	8 331 569	7 488 690	0,24
United States 2.75% 18 - 15.02.28	16 759 000	USD	16 430 171	16 012 727	0,51
United States 2.75% 18 - 28.02.25	6 878 000	USD	6 852 021	6 731 278	0,22

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.75% 18 - 30.06.25	7 116 000	USD	7 057 223	6 939 785	0,22
United States 2.75% 18 - 31.08.25	7 353 000	USD	7 290 792	7 157 674	0,23
United States 2.75% 22 - 15.05.25	10 989 000	USD	10 808 033	10 728 827	0,34
United States 2.75% 22 - 31.05.29	10 376 000	USD	9 908 082	9 798 049	0,31
United States 2.75% 22 - 15.08.32	24 389 000	USD	22 468 456	22 348 346	0,72
United States 2.875% 13 - 15.05.43	10 794 000	USD	9 857 684	8 874 624	0,28
United States 2.875% 15 - 15.08.45	10 842 800	USD	9 646 020	8 758 865	0,28
United States 2.875% 16 - 15.11.46	9 683 000	USD	9 045 382	7 768 270	0,25
United States 2.875% 18 - 30.04.25	6 878 000	USD	6 830 296	6 725 937	0,22
United States 2.875% 18 - 15.05.28	17 179 000	USD	16 825 181	16 474 379	0,53
United States 2.875% 18 - 31.05.25	7 116 000	USD	7 039 630	6 954 206	0,22
United States 2.875% 18 - 31.07.25	7 116 000	USD	7 036 113	6 944 771	0,22
United States 2.875% 18 - 15.08.28	17 860 000	USD	17 602 486	17 091 169	0,55
United States 2.875% 18 - 30.11.25	8 197 800	USD	8 067 543	7 985 804	0,26
United States 2.875% 19 - 15.05.49	12 541 700	USD	10 499 695	9 986 348	0,32
United States 2.875% 22 - 15.05.32	25 251 000	USD	24 038 563	23 408 545	0,75
United States 2.875% 22 - 15.05.52	15 077 000	USD	12 906 350	12 027 500	0,39
United States 2.875% 22 - 15.06.25	10 997 000	USD	10 813 243	10 746 981	0,34
United States 3.00% 12 - 15.05.42	10 550 000	USD	9 874 623	8 948 403	0,29
United States 3.00% 14 - 15.11.44	10 238 300	USD	9 367 776	8 486 511	0,27
United States 3.00% 15 - 15.05.45	10 457 700	USD	9 339 904	8 638 166	0,28
United States 3.00% 15 - 15.11.45	10 667 300	USD	9 429 906	8 792 930	0,28
United States 3.00% 17 - 15.02.47	9 828 000	USD	8 771 829	8 049 669	0,26
United States 3.00% 17 - 15.05.47	9 467 000	USD	8 715 781	7 747 371	0,25
United States 3.00% 18 - 15.02.48	10 579 000	USD	9 547 001	8 641 638	0,28
United States 3.00% 18 - 15.08.48	12 082 400	USD	11 052 685	9 862 183	0,32
United States 3.00% 18 - 30.09.25	7 353 000	USD	7 326 351	7 182 962	0,23
United States 3.00% 18 - 31.10.25	7 352 700	USD	7 298 955	7 180 371	0,23
United States 3.00% 19 - 15.02.49	12 719 000	USD	11 682 331	10 368 996	0,33
United States 3.00% 22 - 15.07.25	10 929 000	USD	10 793 659	10 689 928	0,34
United States 3.00% 22 - 15.08.52	14 174 000	USD	11 809 555	11 612 769	0,37
United States 3.125% 11 - 15.11.41	10 550 000	USD	10 127 749	9 191 556	0,29
United States 3.125% 12 - 15.02.42	10 549 800	USD	10 031 989	9 158 430	0,29
United States 3.125% 13 - 15.02.43	10 375 200	USD	9 757 805	8 878 885	0,28
United States 3.125% 14 - 15.08.44	10 051 000	USD	9 212 064	8 517 414	0,27
United States 3.125% 18 - 15.05.48	10 644 000	USD	9 729 414	8 889 320	0,28
United States 3.125% 18 - 15.11.28	17 755 500	USD	17 626 249	17 152 076	0,55
United States 3.125% 22 - 15.08.25	10 689 000	USD	10 523 776	10 476 047	0,34
United States 3.125% 22 - 31.08.27	11 184 000	USD	10 886 728	10 870 315	0,35
United States 3.125% 22 - 31.08.29	9 876 000	USD	9 557 105	9 489 455	0,30
United States 3.25% 22 - 30.06.27	11 907 000	USD	11 690 189	11 637 213	0,37
United States 3.25% 22 - 30.06.29	10 222 000	USD	9 966 165	9 894 625	0,32
United States 3.375% 14 - 15.05.44	10 461 600	USD	10 326 079	9 235 566	0,30
United States 3.375% 18 - 15.11.48	12 664 800	USD	12 102 914	11 061 852	0,35
United States 3.375% 22 - 15.08.42	9 796 000	USD	8 689 490	8 752 053	0,28
United States 3.375% 23 - 15.05.33	24 899 000	USD	23 838 541	23 903 157	0,77
United States 3.50% 09 - 15.02.39	6 193 000	USD	6 226 626	5 868 777	0,19
United States 3.50% 22 - 15.09.25	10 268 000	USD	10 111 205	10 117 983	0,32

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.50% 23 - 31.01.28	10 301 000	USD	10 093 918	10 138 470	0,32
United States 3.50% 23 - 31.01.30	8 301 000	USD	8 161 676	8 122 652	0,26
United States 3.50% 23 - 15.02.33	24 305 000	USD	23 771 731	23 572 204	0,75
United States 3.50% 23 - 30.04.30	9 001 000	USD	8 771 377	8 800 580	0,28
United States 3.625% 13 - 15.08.43	10 289 000	USD	10 397 222	9 472 279	0,30
United States 3.625% 14 - 15.02.44	10 596 900	USD	10 720 734	9 720 950	0,31
United States 3.625% 23 - 15.02.53	14 273 000	USD	13 466 521	13 201 510	0,42
United States 3.625% 23 - 31.03.28	10 834 000	USD	10 732 510	10 718 034	0,34
United States 3.625% 23 - 31.03.30	8 791 000	USD	8 729 576	8 657 082	0,28
United States 3.625% 23 - 15.05.26	10 265 000	USD	10 141 854	10 147 105	0,32
United States 3.625% 23 - 15.05.53	14 216 000	USD	13 138 879	13 164 382	0,42
United States 3.625% 23 - 31.05.28	10 607 000	USD	10 480 154	10 495 171	0,34
United States 3.75% 11 - 15.08.41	10 360 700	USD	10 669 152	9 878 134	0,32
United States 3.75% 13 - 15.11.43	10 311 000	USD	10 195 391	9 647 165	0,31
United States 3.75% 23 - 15.04.26	9 740 000	USD	9 698 445	9 650 194	0,31
United States 3.75% 23 - 31.05.30	8 306 000	USD	8 250 748	8 235 918	0,26
United States 3.875% 10 - 15.08.40	10 548 300	USD	10 909 647	10 297 679	0,33
United States 3.875% 22 - 30.09.29	8 801 000	USD	8 753 907	8 788 596	0,28
United States 3.875% 22 - 30.11.27	11 341 000	USD	11 263 237	11 317 964	0,36
United States 3.875% 23 - 31.12.27	10 311 000	USD	10 274 134	10 295 703	0,33
United States 3.875% 23 - 31.12.29	8 673 000	USD	8 619 719	8 661 488	0,28
United States 3.875% 23 - 15.01.26	9 652 000	USD	9 603 794	9 578 864	0,31
United States 3.875% 23 - 30.04.25	10 685 000	USD	10 563 367	10 589 820	0,34
United States 3.875% 23 - 15.05.43	9 398 000	USD	8 875 924	8 974 378	0,29
United States 3.875% 23 - 15.08.33	26 601 000	USD	25 324 242	26 574 170	0,85
United States 4.00% 22 - 31.10.29	8 432 000	USD	8 397 333	8 473 521	0,27
United States 4.00% 22 - 15.11.52	13 994 000	USD	13 903 841	13 837 672	0,44
United States 4.00% 22 - 15.11.42	9 709 000	USD	9 569 911	9 456 331	0,30
United States 4.00% 22 - 15.12.25	10 178 000	USD	10 107 178	10 124 717	0,32
United States 4.00% 23 - 15.02.26	10 198 000	USD	10 091 687	10 151 790	0,33
United States 4.00% 23 - 28.02.30	9 347 000	USD	9 309 264	9 395 948	0,30
United States 4.00% 23 - 30.06.28	10 687 000	USD	10 602 360	10 739 592	0,34
United States 4.00% 23 - 31.07.30	8 614 000	USD	8 508 008	8 663 133	0,28
United States 4.125% 22 - 30.09.27	11 159 000	USD	11 152 674	11 231 368	0,36
United States 4.125% 22 - 31.10.27	9 936 000	USD	9 920 350	9 999 653	0,32
United States 4.125% 22 - 15.11.32	25 060 000	USD	25 537 128	25 477 151	0,82
United States 4.125% 23 - 31.01.25	10 420 000	USD	10 386 627	10 354 875	0,33
United States 4.125% 23 - 15.06.26	10 192 000	USD	10 101 051	10 191 212	0,33
United States 4.125% 23 - 31.07.28	11 343 000	USD	11 312 543	11 460 870	0,37
United States 4.125% 23 - 15.08.53	15 694 000	USD	14 456 142	15 889 133	0,51
United States 4.125% 23 - 31.08.30	9 244 000	USD	9 163 868	9 363 183	0,30
United States 4.25% 09 - 15.05.39	10 421 000	USD	11 270 127	10 744 108	0,34
United States 4.25% 10 - 15.11.40	10 782 700	USD	11 682 841	11 005 776	0,35
United States 4.25% 22 - 15.10.25	10 257 000	USD	10 211 791	10 237 768	0,33
United States 4.25% 23 - 31.05.25	10 418 000	USD	10 370 785	10 379 738	0,33
United States 4.375% 08 - 15.02.38	5 421 000	USD	6 027 417	5 703 404	0,18
United States 4.375% 09 - 15.11.39	10 782 000	USD	11 916 072	11 242 703	0,36
United States 4.375% 10 - 15.05.40	10 754 800	USD	11 918 849	11 184 841	0,36

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.375% 11 - 15.05.41	9 788 700	USD	10 807 150	10 109 754	0,32
United States 4.375% 23 - 15.08.26	10 621 000	USD	10 574 959	10 697 305	0,34
United States 4.375% 23 - 31.08.28	11 613 000	USD	11 657 274	11 862 507	0,38
United States 4.375% 23 - 15.08.43	10 443 000	USD	9 811 700	10 677 951	0,34
United States 4.375% 23 - 30.11.28	13 503 000	USD	13 621 069	13 819 477	0,44
United States 4.375% 23 - 30.11.30	9 667 000	USD	9 676 375	9 944 194	0,32
United States 4.375% 23 - 15.12.26	12 450 000	USD	12 573 083	12 573 549	0,40
United States 4.50% 06 - 15.02.36	6 528 300	USD	7 469 146	6 968 899	0,22
United States 4.50% 08 - 15.05.38	6 346 700	USD	7 293 729	6 750 722	0,22
United States 4.50% 09 - 15.08.39	10 190 400	USD	11 467 152	10 800 088	0,35
United States 4.50% 22 - 15.11.25	9 999 000	USD	10 036 064	10 032 583	0,32
United States 4.50% 23 - 15.07.26	9 869 000	USD	9 858 583	9 963 064	0,32
United States 4.50% 23 - 30.09.30	9 232 000	USD	9 132 568	9 625 831	0,31
United States 4.50% 24 - 15.11.33	10 013 000	USD	10 138 469	10 516 826	0,34
United States 4.625% 10 - 15.02.40	11 740 000	USD	13 406 388	12 581 868	0,40
United States 4.625% 23 - 28.02.25	10 377 000	USD	10 354 552	10 372 103	0,33
United States 4.625% 23 - 15.03.26	10 191 000	USD	10 294 345	10 280 171	0,33
United States 4.625% 23 - 15.09.26	11 079 000	USD	11 041 158	11 230 497	0,36
United States 4.625% 23 - 15.10.26	11 633 000	USD	11 575 425	11 810 194	0,38
United States 4.625% 23 - 15.11.26	12 100 000	USD	12 153 903	12 291 908	0,39
United States 4.75% 07 - 15.02.37	4 006 800	USD	4 466 500	4 388 326	0,14
United States 4.75% 11 - 15.02.41	10 826 900	USD	12 576 042	11 728 442	0,38
United States 4.75% 23 - 31.07.25	10 619 000	USD	10 594 412	10 667 101	0,34
United States 4.75% 23 - 15.11.43	4 100 000	USD	4 142 252	4 404 620	0,14
United States 4.75% 24 - 15.11.53	5 734 000	USD	5 997 429	6 440 979	0,21
United States 4.875% 23 - 31.10.28	12 988 000	USD	13 050 643	13 558 254	0,43
United States 4.875% 23 - 31.10.30	9 213 000	USD	9 276 696	9 747 807	0,31
United States 4.875% 23 - 30.11.25	13 439 000	USD	13 504 848	13 580 729	0,43
United States 5.00% 07 - 15.05.37	5 310 600	USD	6 203 756	5 945 308	0,19
United States 5.00% 23 - 31.08.25	11 810 000	USD	11 846 329	11 918 873	0,38
United States 5.00% 23 - 31.10.25	12 716 000	USD	12 718 335	12 862 025	0,41
United States 5.25% 98 - 15.11.28	2 125 100	USD	2 287 922	2 248 937	0,07
United States 5.25% 99 - 15.02.29	3 098 000	USD	3 331 844	3 280 022	0,11
United States 5.375% 01 - 15.02.31	3 896 300	USD	4 339 110	4 256 702	0,14
United States 5.50% 98 - 15.08.28	2 615 000	USD	2 835 305	2 790 274	0,09
United States 6.00% 96 - 15.02.26	3 044 000	USD	3 265 163	3 137 986	0,10
United States 6.125% 97 - 15.11.27	5 146 800	USD	5 621 122	5 536 823	0,18
United States 6.125% 99 - 15.08.29	2 647 500	USD	2 970 278	2 933 540	0,09
United States 6.25% 00 - 15.05.30	4 562 700	USD	5 304 851	5 149 420	0,16
United States 6.375% 97 - 15.08.27	2 275 000	USD	2 533 480	2 449 366	0,08
United States 6.50% 96 - 15.11.26	2 662 300	USD	2 860 795	2 828 694	0,09
United States 6.625% 97 - 15.02.27	2 391 300	USD	2 632 860	2 564 824	0,08
United States 6.75% 96 - 15.08.26	2 091 000	USD	2 269 100	2 218 919	0,07
United States 6.875% 95 - 15.08.25	3 401 000	USD	3 577 892	3 519 283	0,11
United States 7.625% 95 - 15.02.25	2 495 000	USD	2 582 330	2 575 694	0,08
			3 199 547 185	3 110 048 696	99,55
Total - Obligations			3 199 547 185	3 110 048 696	99,55

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Dollar Fund-Z-	1	USD	7 429	7 430	0,00
			7 429	7 430	0,00
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			7 429	7 430	0,00
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			3 199 554 614	3 110 056 126	99,55
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			3 199 554 614	3 110 056 126	99,55
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				3 133 025 140	100,28

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 20 - 31.10.25	2 515 000	USD	2 330 955	2 336 001	1,29
United States Zero Coupon 21 - 31.01.26	2 759 000	USD	2 532 181	2 548 626	1,40
United States Zero Coupon 21 - 31.03.26	2 695 000	USD	2 495 743	2 500 042	1,38
United States Zero Coupon 21 - 30.04.26	2 720 000	USD	2 503 790	2 516 846	1,38
United States Zero Coupon 21 - 30.06.26	2 695 000	USD	2 464 510	2 492 871	1,37
United States Zero Coupon 21 - 31.07.26	2 691 000	USD	2 435 083	2 464 996	1,36
United States Zero Coupon 21 - 30.09.26	2 746 000	USD	2 473 896	2 522 883	1,39
United States Zero Coupon 21 - 30.11.26	2 700 000	USD	2 496 080	2 497 074	1,37
United States Zero Coupon 23 - 31.12.24	1 898 000	USD	1 886 910	1 887 914	1,04
United States Zero Coupon 23 - 31.03.25	1 885 000	USD	1 869 241	1 868 503	1,03
United States Zero Coupon 23 - 30.06.25	1 958 000	USD	1 950 552	1 962 740	1,08
United States Zero Coupon 23 - 30.09.25	2 100 000	USD	2 099 090	2 121 656	1,17
United States 0.25% 20 - 31.05.25	1 920 000	USD	1 814 293	1 808 248	0,99
United States 0.25% 20 - 30.06.25	2 100 000	USD	1 978 036	1 972 359	1,09
United States 0.25% 20 - 31.07.25	2 194 000	USD	2 051 622	2 054 645	1,13
United States 0.25% 20 - 31.08.25	2 273 000	USD	2 115 997	2 122 234	1,17
United States 0.25% 20 - 30.09.25	2 439 000	USD	2 264 969	2 271 319	1,25
United States 0.375% 20 - 30.04.25	2 002 000	USD	1 897 719	1 894 393	1,04
United States 0.375% 20 - 30.11.25	2 530 000	USD	2 340 771	2 349 538	1,29
United States 0.375% 20 - 31.12.25	2 655 000	USD	2 455 042	2 460 233	1,35
United States 0.50% 20 - 31.03.25	1 851 000	USD	1 761 879	1 760 036	0,97
United States 0.50% 21 - 28.02.26	2 685 000	USD	2 477 802	2 480 692	1,36
United States 0.75% 21 - 31.05.26	2 695 000	USD	2 461 371	2 487 822	1,37
United States 0.75% 21 - 31.08.26	2 824 000	USD	2 548 064	2 589 692	1,42
United States 1.125% 20 - 28.02.25	1 868 000	USD	1 801 814	1 794 442	0,99
United States 1.125% 21 - 31.10.26	2 824 000	USD	2 579 627	2 606 673	1,43
United States 1.125% 22 - 15.01.25	2 358 000	USD	2 280 914	2 271 417	1,25
United States 1.375% 19 - 31.08.26	1 408 000	USD	1 290 420	1 312 738	0,72
United States 1.375% 20 - 31.01.25	1 881 000	USD	1 819 825	1 814 726	1,00
United States 1.50% 16 - 15.08.26	2 868 000	USD	2 655 587	2 684 708	1,48
United States 1.50% 22 - 15.02.25	2 230 000	USD	2 162 353	2 151 605	1,18
United States 1.625% 16 - 15.02.26	2 828 000	USD	2 660 475	2 679 753	1,47
United States 1.625% 16 - 15.05.26	2 784 000	USD	2 613 153	2 626 534	1,45
United States 1.625% 19 - 30.09.26	1 402 000	USD	1 287 700	1 315 028	0,72
United States 1.625% 19 - 31.10.26	1 440 000	USD	1 332 758	1 348 532	0,74
United States 1.625% 19 - 30.11.26	1 450 000	USD	1 354 721	1 355 409	0,75
United States 1.75% 19 - 31.12.24	1 858 000	USD	1 811 305	1 803 272	0,99
United States 1.75% 22 - 15.03.25	2 087 000	USD	2 025 466	2 016 241	1,11
United States 1.875% 19 - 30.06.26	1 506 000	USD	1 413 384	1 428 461	0,79
United States 1.875% 19 - 31.07.26	1 430 000	USD	1 338 566	1 352 803	0,74
United States 2.00% 15 - 15.02.25	2 910 000	USD	2 830 767	2 824 514	1,55
United States 2.00% 15 - 15.08.25	2 911 000	USD	2 802 024	2 801 378	1,54
United States 2.00% 16 - 15.11.26	2 828 000	USD	2 644 387	2 674 000	1,47
United States 2.125% 15 - 15.05.25	2 892 000	USD	2 803 972	2 799 585	1,54
United States 2.125% 19 - 31.05.26	1 335 000	USD	1 259 914	1 274 611	0,70
United States 2.25% 15 - 15.11.25	2 982 000	USD	2 861 424	2 872 039	1,58
United States 2.25% 18 - 31.12.24	1 211 000	USD	1 187 135	1 181 008	0,65
United States 2.25% 19 - 31.03.26	1 442 000	USD	1 383 110	1 383 196	0,76

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.375% 19 - 30.04.26	1 508 000	USD	1 443 244	1 449 091	0,80
United States 2.50% 18 - 31.01.25	1 223 000	USD	1 197 240	1 194 334	0,66
United States 2.50% 19 - 28.02.26	1 402 000	USD	1 352 299	1 352 930	0,74
United States 2.625% 18 - 31.03.25	1 252 000	USD	1 226 443	1 222 071	0,67
United States 2.625% 18 - 31.12.25	1 394 000	USD	1 347 220	1 350 981	0,74
United States 2.625% 19 - 31.01.26	1 485 000	USD	1 427 081	1 438 017	0,79
United States 2.625% 22 - 15.04.25	1 996 000	USD	1 950 552	1 947 033	1,07
United States 2.75% 18 - 28.02.25	1 252 000	USD	1 227 258	1 225 292	0,67
United States 2.75% 18 - 30.06.25	1 293 000	USD	1 263 304	1 260 981	0,69
United States 2.75% 18 - 31.08.25	1 470 000	USD	1 426 899	1 430 951	0,79
United States 2.75% 22 - 15.05.25	2 020 000	USD	1 979 394	1 972 175	1,09
United States 2.875% 18 - 30.04.25	1 272 000	USD	1 248 564	1 243 878	0,68
United States 2.875% 18 - 31.05.25	1 422 000	USD	1 394 299	1 389 668	0,76
United States 2.875% 18 - 31.07.25	1 278 000	USD	1 246 133	1 247 248	0,69
United States 2.875% 18 - 30.11.25	1 390 000	USD	1 348 600	1 354 054	0,75
United States 2.875% 22 - 15.06.25	1 912 000	USD	1 872 711	1 868 530	1,03
United States 3.00% 18 - 30.09.25	1 430 000	USD	1 390 250	1 396 931	0,77
United States 3.00% 18 - 31.10.25	1 414 000	USD	1 378 368	1 380 859	0,76
United States 3.00% 22 - 15.07.25	1 888 000	USD	1 854 852	1 846 700	1,02
United States 3.125% 22 - 15.08.25	1 885 000	USD	1 847 543	1 847 446	1,02
United States 3.50% 22 - 15.09.25	1 881 000	USD	1 847 921	1 853 518	1,02
United States 3.625% 23 - 15.05.26	1 738 000	USD	1 708 628	1 718 039	0,95
United States 3.75% 23 - 15.04.26	1 796 000	USD	1 778 265	1 779 440	0,98
United States 3.875% 23 - 15.01.26	1 760 000	USD	1 744 531	1 746 664	0,96
United States 3.875% 23 - 30.04.25	1 958 000	USD	1 936 452	1 940 559	1,07
United States 4.00% 22 - 15.12.25	1 760 000	USD	1 743 913	1 750 786	0,96
United States 4.00% 23 - 15.02.26	1 796 000	USD	1 774 924	1 787 862	0,98
United States 4.125% 23 - 31.01.25	1 867 000	USD	1 854 814	1 855 331	1,02
United States 4.125% 23 - 15.06.26	1 796 000	USD	1 776 164	1 795 861	0,99
United States 4.25% 22 - 15.10.25	1 796 000	USD	1 784 845	1 792 633	0,99
United States 4.25% 23 - 31.05.25	1 882 000	USD	1 868 894	1 875 088	1,03
United States 4.375% 23 - 15.08.26	1 885 000	USD	1 874 201	1 898 543	1,04
United States 4.375% 23 - 15.12.26	2 290 000	USD	2 312 041	2 312 725	1,27
United States 4.50% 22 - 15.11.25	1 766 000	USD	1 763 783	1 771 931	0,97
United States 4.50% 23 - 15.07.26	1 722 000	USD	1 717 234	1 738 413	0,96
United States 4.625% 23 - 28.02.25	1 905 000	USD	1 897 566	1 904 101	1,05
United States 4.625% 23 - 15.03.26	1 737 000	USD	1 747 942	1 752 199	0,96
United States 4.625% 23 - 15.09.26	1 975 000	USD	1 967 496	2 002 007	1,10
United States 4.625% 23 - 15.10.26	2 114 000	USD	2 105 447	2 146 201	1,18
United States 4.625% 23 - 15.11.26	2 206 000	USD	2 218 545	2 240 988	1,23
United States 4.75% 23 - 31.07.25	1 885 000	USD	1 879 662	1 893 538	1,04
United States 4.875% 23 - 30.11.25	2 380 000	USD	2 391 161	2 405 100	1,32
United States 5.00% 23 - 31.08.25	2 020 000	USD	2 023 262	2 038 622	1,12
United States 5.00% 23 - 31.10.25	2 332 000	USD	2 333 298	2 358 780	1,30
United States 6.00% 96 - 15.02.26	535 000	USD	549 608	551 519	0,30
United States 6.50% 96 - 15.11.26	500 000	USD	527 395	531 250	0,29
United States 6.75% 96 - 15.08.26	427 000	USD	448 985	453 122	0,25

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 6.875% 95 - 15.08.25	502 000	USD	521 103	519 459	0,29
United States 7.625% 95 - 15.02.25	408 000	USD	423 807	421 196	0,23
			179 850 538	180 598 681	99,33
Total - Obligations			179 850 538	180 598 681	99,33
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			179 850 538	180 598 681	99,33
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			179 850 538	180 598 681	99,33
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				181 802 773	99,99

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
APA Infrastructure Ltd. 0.75% 21 - 15.03.29	1 000 000	EUR	864 309	870 180	0,02
APA Infrastructure Ltd. 1.25% 21 - 15.03.33	800 000	EUR	614 832	645 528	0,02
APA Infrastructure Ltd. 2.00% 15 - 22.03.27	979 000	EUR	950 801	935 180	0,02
APA Infrastructure Ltd. 2.00% 20 - 15.07.30	759 000	EUR	678 314	683 753	0,02
Aurizon Network Pty Ltd. 3.125% 16 - 01.06.26	800 000	EUR	788 519	792 560	0,02
Ausgrid Finance Pty Ltd. 0.875% 21 - 07.10.31	734 000	EUR	592 942	598 328	0,02
Ausgrid Finance Pty Ltd. 1.25% 18 - 30.07.25	957 000	EUR	938 895	923 122	0,02
AusNet Services Holdings Pty Ltd. 0.625% 20 - 25.08.30	641 000	EUR	535 119	540 158	0,01
AusNet Services Holdings Pty Ltd. 1.50% 15 - 26.02.27	883 000	EUR	834 038	830 726	0,02
AusNet Services Holdings Pty Ltd. FRN 21 - 11.03.81	1 116 000	EUR	987 873	1 007 692	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 21 - 05.05.31	1 300 000	EUR	1 169 442	1 191 138	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0.75% 16 - 29.09.26	1 100 000	EUR	1 052 311	1 032 493	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3.652% 23 - 20.01.26	1 500 000	EUR	1 495 311	1 511 160	0,04
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 23 - 03.02.33	1 600 000	EUR	1 594 497	1 644 368	0,04
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd. 4.375% 23 - 24.05.33	700 000	EUR	699 144	740 411	0,02
BHP Billiton Finance Ltd. 1.50% 15 - 29.04.30	1 098 000	EUR	988 645	983 577	0,02
BHP Billiton Finance Ltd. 3.125% 13 - 29.04.33	1 200 000	EUR	1 221 805	1 169 784	0,03
BHP Billiton Finance Ltd. 3.25% 12 - 24.09.27	1 100 000	EUR	1 135 310	1 110 395	0,03
CIMIC Finance Ltd. 1.50% 21 - 28.05.29	895 000	EUR	755 912	776 941	0,02
Commonwealth Bank of Australia 1.125% 18 - 18.01.28	852 000	EUR	797 863	799 116	0,02
Goodman Australia Finance Pty Ltd. 1.375% 17 - 27.09.25	900 000	EUR	854 109	869 886	0,02
Macquarie Group Ltd. 0.35% 20 - 03.03.28	1 040 000	EUR	933 013	919 953	0,02
Macquarie Group Ltd. 0.625% 20 - 03.02.27	720 000	EUR	657 801	660 838	0,02
Macquarie Group Ltd. 0.943% 22 - 19.01.29	800 000	EUR	682 391	702 816	0,02
Macquarie Group Ltd. 0.95% 21 - 21.05.31	900 000	EUR	709 365	746 478	0,02
Macquarie Group Ltd. 4.747% 23 - 23.01.30	1 250 000	EUR	1 273 806	1 314 475	0,03
National Australia Bank Ltd. 1.125% 19 - 20.05.31	500 000	EUR	426 148	447 970	0,01
National Australia Bank Ltd. 1.25% 16 - 18.05.26	1 168 000	EUR	1 150 851	1 126 793	0,03
National Australia Bank Ltd. 1.375% 18 - 30.08.28	1 999 000	EUR	1 889 749	1 848 196	0,05
National Australia Bank Ltd. 2.125% 22 - 24.05.28	1 553 000	EUR	1 499 097	1 499 623	0,04
Origin Energy Finance Ltd. 1.00% 19 - 17.09.29	859 000	EUR	790 650	748 120	0,02
Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 1.45% 19 - 28.03.29	762 000	EUR	671 001	671 314	0,02
Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 1.75% 18 - 11.04.28	686 000	EUR	619 302	625 166	0,02
Stockland Trust 1.625% 18 - 27.04.26	280 000	EUR	261 261	265 896	0,01
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 18 - 26.04.28	828 000	EUR	783 652	778 966	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 4.375% 23 - 03.05.33	1 500 000	EUR	1 500 463	1 577 805	0,04
Telstra Corp. Ltd. 1.00% 20 - 23.04.30	695 000	EUR	606 190	619 113	0,02
Telstra Corp. Ltd. 1.125% 16 - 14.04.26	893 000	EUR	864 862	856 101	0,02
Telstra Corp. Ltd. 1.375% 19 - 26.03.29	1 121 000	EUR	1 026 473	1 035 703	0,03
Telstra Group Ltd. 3.75% 23 - 04.05.31	660 000	EUR	657 603	691 964	0,02
Toyota Finance Australia Ltd. 0.064% 22 - 13.01.25	900 000	EUR	878 431	868 536	0,02
Toyota Finance Australia Ltd. 0.44% 22 - 13.01.28	890 000	EUR	798 292	804 035	0,02
Toyota Finance Australia Ltd. 2.28% 20 - 21.10.27	723 000	EUR	711 449	705 012	0,02
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.45% 19 - 16.05.29	908 000	EUR	827 409	827 115	0,02
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 17 - 29.03.28	750 000	EUR	698 264	706 560	0,02
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 2.00% 15 - 28.08.25	800 000	EUR	790 259	781 624	0,02
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 3.00% 20 - 08.04.30	1 200 000	EUR	1 162 612	1 174 080	0,03
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 4.225% 23 - 26.04.33	890 000	EUR	893 151	936 707	0,02
Vicinity Centres Trust 1.125% 19 - 07.11.29	750 000	EUR	610 868	635 783	0,02
Wesfarmers Ltd. 0.954% 21 - 21.10.33	900 000	EUR	689 075	724 050	0,02
Westpac Banking Corp. FRN 21 - 13.05.31	1 400 000	EUR	1 279 588	1 283 296	0,03
Westpac Banking Corp. 0.875% 16 - 17.04.27	752 000	EUR	702 026	697 818	0,02
Westpac Banking Corp. 1.125% 17 - 05.09.27	1 180 000	EUR	1 118 381	1 097 247	0,03
Westpac Banking Corp. 1.45% 18 - 17.07.28	1 478 000	EUR	1 374 251	1 378 132	0,04
Westpac Banking Corp. 3.703% 23 - 16.01.26	1 604 000	EUR	1 601 300	1 618 067	0,04
Westpac Banking Corp. 3.799% 23 - 17.01.30	802 000	EUR	795 695	826 541	0,02
Woolworths Group Ltd. 0.375% 21 - 15.11.28	660 000	EUR	560 645	567 428	0,01
			52 045 365	52 425 817	1,36
Autriche					
A1 Towers Holding GmbH 5.25% 23 - 13.07.28	600 000	EUR	613 405	635 010	0,02
BAWAG Group AG FRN 23 - 24.02.34	600 000	EUR	599 136	611 412	0,02
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0.375% 19 - 03.09.27	400 000	EUR	350 587	359 848	0,01
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 4.125% 23 - 18.01.27	800 000	EUR	802 298	811 288	0,02
Borealis AG 1.75% 18 - 10.12.25	411 500	EUR	399 191	397 970	0,01
CA Immobilien Anlagen AG 0.875% 20 - 05.02.27	400 000	EUR	344 255	355 984	0,01
CA Immobilien Anlagen AG 1.00% 20 - 27.10.25	900 000	EUR	826 651	823 437	0,02
Erste Group Bank AG 0.05% 20 - 16.09.25	800 000	EUR	770 406	756 160	0,02
Erste Group Bank AG FRN 20 - 16.11.28	1 100 000	EUR	974 239	971 157	0,03
Erste Group Bank AG 0.125% 21 - 17.05.28	500 000	EUR	448 871	438 660	0,01
Erste Group Bank AG 0.25% 21 - 27.01.31	600 000	EUR	473 112	489 096	0,01
Erste Group Bank AG 0.25% 21 - 14.09.29	700 000	EUR	612 443	590 128	0,02
Erste Group Bank AG 0.875% 19 - 22.05.26	800 000	EUR	753 693	757 824	0,02
Erste Group Bank AG 0.875% 20 - 13.05.27	1 100 000	EUR	1 011 196	1 019 667	0,03
Erste Group Bank AG FRN 21 - 15.11.32	900 000	EUR	784 460	786 582	0,02
Erste Group Bank AG FRN 19 - 10.06.30	500 000	EUR	462 953	471 695	0,01
Erste Group Bank AG 1.50% 22 - 07.04.26	1 000 000	EUR	963 643	962 320	0,02
Erste Group Bank AG FRN 20 - 08.09.31	600 000	EUR	553 233	559 836	0,01
Erste Group Bank AG FRN 22 - 07.06.33	800 000	EUR	759 213	786 656	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Erste Group Bank AG FRN 23 - 16.01.31	1 200 000	EUR	1 192 897	1 241 868	0,03
Erste Group Bank AG FRN 23 - 30.05.30	1 000 000	EUR	1 002 134	1 037 860	0,03
Mondi Finance Europe GmbH 2.375% 20 - 01.04.28	1 151 000	EUR	1 118 936	1 127 796	0,03
OMV AG Zero Coupon 19 - 03.07.25	832 000	EUR	797 418	792 289	0,02
OMV AG 0.75% 20 - 16.06.30	1 216 000	EUR	1 049 313	1 056 947	0,03
OMV AG 1.00% 17 - 14.12.26	1 543 000	EUR	1 497 054	1 467 177	0,04
OMV AG 1.00% 19 - 03.07.34	863 000	EUR	668 505	689 813	0,02
OMV AG 1.875% 18 - 04.12.28	808 000	EUR	787 660	769 281	0,02
OMV AG 2.00% 20 - 09.04.28	803 000	EUR	763 759	778 468	0,02
OMV AG 2.375% 20 - 09.04.32	1 000 000	EUR	985 165	956 370	0,02
OMV AG FRN 20 - 31.12.99	1 000 000	EUR	945 119	941 670	0,02
OMV AG FRN 20 - 31.12.99	900 000	EUR	780 860	796 743	0,02
OMV AG 3.50% 12 - 27.09.27	1 200 000	EUR	1 246 286	1 227 144	0,03
OMV AG FRN 15 - 29.12.49	1 037 000	EUR	1 119 176	1 072 942	0,03
Raiffeisen Bank International AG 0.05% 21 - 01.09.27	600 000	EUR	513 435	523 104	0,01
Raiffeisen Bank International AG 0.25% 20 - 22.01.25	1 200 000	EUR	1 160 555	1 153 956	0,03
Raiffeisen Bank International AG 0.375% 19 - 25.09.26	1 100 000	EUR	1 006 049	1 005 862	0,03
Raiffeisen Bank International AG FRN 21 - 17.06.33	700 000	EUR	535 177	572 341	0,01
Raiffeisen Bank International AG FRN 19 - 12.03.30	700 000	EUR	628 500	652 435	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 20 - 18.06.32	800 000	EUR	679 355	716 872	0,02
Raiffeisen Bank International AG 4.125% 22 - 08.09.25	800 000	EUR	793 147	804 472	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 23 - 26.01.27	1 600 000	EUR	1 587 321	1 617 744	0,04
Raiffeisen Bank International AG 5.75% 22 - 27.01.28	600 000	EUR	612 819	641 982	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 23 - 15.09.28	900 000	EUR	898 166	938 934	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 22 - 20.12.32	800 000	EUR	802 262	841 936	0,02
Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 16 - 07.12.26	1 100 000	EUR	1 067 426	1 059 685	0,03
UNIQA Insurance Group AG 1.375% 20 - 09.07.30	1 100 000	EUR	976 809	953 062	0,02
UNIQA Insurance Group AG FRN 21 - 09.12.41	500 000	EUR	406 851	404 790	0,01
UNIQA Insurance Group AG FRN 15 - 27.07.46	400 000	EUR	405 720	410 232	0,01
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe 1.00% 21 - 26.03.36	600 000	EUR	444 820	479 922	0,01
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 22 - 15.06.42	900 000	EUR	846 646	902 844	0,02
Volksbank Wien AG 0.875% 21 - 23.03.26	700 000	EUR	642 377	650 748	0,02
Volksbank Wien AG 4.75% 23 - 15.03.27	400 000	EUR	398 659	410 744	0,01
Volksbank Wien AG 4.75% 23 - 15.03.27	200 000	EUR	198 707	205 372	0,01
Wienerberger AG 2.75% 20 - 04.06.25	400 000	EUR	389 446	392 980	0,01
Wienerberger AG 4.875% 23 - 04.10.28	700 000	EUR	696 861	742 007	0,02
			42 148 375	42 623 122	1,10
Belgique					
Aedifica SA 0.75% 21 - 09.09.31	800 000	EUR	619 660	636 376	0,02
AG Insurance SA FRN 15 - 30.06.47	600 000	EUR	573 516	575 880	0,01
Ageas SA FRN 20 - 24.11.51	900 000	EUR	704 192	720 171	0,02
Ageas SA FRN 19 - 02.07.49	700 000	EUR	613 721	653 422	0,02
Aliaxis Finance SA 0.875% 21 - 08.11.28	700 000	EUR	595 237	593 096	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Aliaxis Finance SA 0.875% 21 - 08.11.28	300 000	EUR	260 261	254 184	0,01
Anheuser-Busch InBev SA 1.125% 19 - 01.07.27	1 508 000	EUR	1 329 516	1 423 763	0,04
Anheuser-Busch InBev SA 1.125% 19 - 01.07.27	400 000	EUR	371 116	377 656	0,01
Anheuser-Busch InBev SA 1.15% 18 - 22.01.27	3 029 000	EUR	2 945 963	2 877 096	0,07
Anheuser-Busch InBev SA 1.50% 15 - 18.04.30	2 126 000	EUR	1 986 904	1 955 197	0,05
Anheuser-Busch InBev SA 1.65% 19 - 28.03.31	1 214 000	EUR	1 174 772	1 113 614	0,03
Anheuser-Busch InBev SA 1.65% 19 - 28.03.31	200 000	EUR	177 060	183 462	0,00
Anheuser-Busch InBev SA 2.00% 16 - 17.03.28	4 000 000	EUR	3 952 480	3 886 200	0,10
Anheuser-Busch InBev SA 2.00% 16 - 17.03.28	500 000	EUR	476 494	485 775	0,01
Anheuser-Busch InBev SA 2.00% 18 - 23.01.35	1 100 000	EUR	984 008	985 182	0,03
Anheuser-Busch InBev SA 2.125% 20 - 02.12.27	1 400 000	EUR	1 388 887	1 363 446	0,04
Anheuser-Busch InBev SA 2.70% 14 - 31.03.26	900 000	EUR	902 811	890 442	0,02
Anheuser-Busch InBev SA 2.70% 14 - 31.03.26	400 000	EUR	397 350	395 752	0,01
Anheuser-Busch InBev SA 2.75% 16 - 17.03.36	4 200 000	EUR	4 035 703	4 002 852	0,10
Anheuser-Busch InBev SA 2.875% 20 - 02.04.32	1 900 000	EUR	1 920 939	1 879 746	0,05
Anheuser-Busch InBev SA 2.875% 20 - 02.04.32	700 000	EUR	665 941	692 538	0,02
Anheuser-Busch InBev SA 3.25% 13 - 24.01.33	803 000	EUR	823 971	820 192	0,02
Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 20 - 02.04.40	2 400 000	EUR	2 185 301	2 452 320	0,06
Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 20 - 02.04.40	200 000	EUR	188 370	204 360	0,01
Argenta Spaarbank NV 1.00% 20 - 29.01.27	900 000	EUR	816 218	821 295	0,02
Argenta Spaarbank NV FRN 20 - 13.10.26	900 000	EUR	843 405	849 447	0,02
Argenta Spaarbank NV FRN 22 - 08.02.29	700 000	EUR	608 824	621 880	0,02
Argenta Spaarbank NV FRN 22 - 29.11.27	800 000	EUR	805 889	827 312	0,02
Argenta Spaarbank NV FRN 22 - 29.11.27	200 000	EUR	197 756	206 828	0,01
Cofinimmo SA 0.875% 20 - 02.12.30	900 000	EUR	694 390	730 584	0,02
Cofinimmo SA 1.00% 22 - 24.01.28	700 000	EUR	608 469	633 836	0,02
Crelan SA 5.375% 22 - 31.10.25	300 000	EUR	300 581	308 277	0,01
Crelan SA 5.75% 23 - 26.01.28	700 000	EUR	706 040	732 816	0,02
Crelan SA FRN 23 - 28.02.30	1 100 000	EUR	1 096 975	1 163 965	0,03
Elia Group SA 1.50% 18 - 05.09.28	200 000	EUR	182 001	185 964	0,00
Elia Transmission Belgium SA 0.875% 20 - 28.04.30	1 000 000	EUR	939 274	871 730	0,02
Elia Transmission Belgium SA 0.875% 20 - 28.04.30	200 000	EUR	169 409	174 346	0,00
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 19 - 14.01.26	900 000	EUR	866 275	865 287	0,02
Elia Transmission Belgium SA 3.00% 14 - 07.04.29	600 000	EUR	580 776	594 366	0,02
Elia Transmission Belgium SA 3.25% 13 - 04.04.28	1 000 000	EUR	1 019 312	1 009 070	0,03
Elia Transmission Belgium SA 3.625% 23 - 18.01.33	700 000	EUR	682 468	722 449	0,02
Elia Transmission Belgium SA 3.625% 23 - 18.01.33	200 000	EUR	197 998	206 414	0,01
Euroclear Bank SA 0.125% 20 - 07.07.25	573 000	EUR	558 489	546 929	0,01
Euroclear Bank SA 0.125% 20 - 07.07.25	100 000	EUR	95 215	95 450	0,00
Euroclear Bank SA 3.625% 22 - 13.10.27	600 000	EUR	595 671	613 416	0,02
Euroclear Bank SA 3.625% 22 - 13.10.27	300 000	EUR	299 477	306 708	0,01
Groupe Bruxelles Lambert NV 0.125% 21 - 28.01.31	600 000	EUR	475 585	483 048	0,01
Groupe Bruxelles Lambert NV 1.875% 18 - 19.06.25	900 000	EUR	888 283	879 993	0,02
Groupe Bruxelles Lambert NV 3.125% 22 - 06.09.29	800 000	EUR	776 902	802 344	0,02
Groupe Bruxelles Lambert NV 4.00% 23 - 15.05.33	800 000	EUR	807 314	840 920	0,02
KBC Group NV FRN 20 - 10.09.26	1 100 000	EUR	1 035 977	1 037 267	0,03
KBC Group NV FRN 21 - 14.01.29	1 300 000	EUR	1 142 813	1 137 565	0,03
KBC Group NV FRN 21 - 01.03.27	1 500 000	EUR	1 430 309	1 402 890	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
KBC Group NV FRN 21 - 01.03.27	100 000	EUR	91 619	93 526	0,00
KBC Group NV FRN 20 - 16.06.27	800 000	EUR	741 915	745 200	0,02
KBC Group NV 0.625% 19 - 10.04.25	300 000	EUR	286 594	289 671	0,01
KBC Group NV FRN 21 - 07.12.31	1 300 000	EUR	1 141 428	1 173 250	0,03
KBC Group NV 0.75% 20 - 24.01.30	400 000	EUR	333 533	343 504	0,01
KBC Group NV 0.75% 20 - 24.01.30	100 000	EUR	82 148	85 876	0,00
KBC Group NV 0.75% 21 - 31.05.31	1 100 000	EUR	902 058	922 328	0,02
KBC Group NV FRN 22 - 21.01.28	900 000	EUR	833 832	828 144	0,02
KBC Group NV FRN 22 - 21.01.28	100 000	EUR	89 364	92 016	0,00
KBC Group NV FRN 22 - 29.03.26	1 200 000	EUR	1 168 017	1 167 372	0,03
KBC Group NV 3.00% 22 - 25.08.30	1 300 000	EUR	1 225 866	1 266 798	0,03
KBC Group NV FRN 23 - 28.11.29	700 000	EUR	696 478	719 222	0,02
KBC Group NV FRN 22 - 23.11.27	1 600 000	EUR	1 607 030	1 637 584	0,04
KBC Group NV FRN 23 - 19.04.30	1 400 000	EUR	1 400 070	1 453 214	0,04
KBC Group NV 4.375% 23 - 06.12.31	1 200 000	EUR	1 209 318	1 264 044	0,03
KBC Group NV FRN 23 - 06.06.26	1 900 000	EUR	1 898 554	1 920 577	0,05
KBC Group NV FRN 23 - 25.04.33	900 000	EUR	887 952	919 962	0,02
Lonza Finance International NV 1.625% 20 - 21.04.27	500 000	EUR	488 580	479 200	0,01
Lonza Finance International NV 3.875% 23 - 25.05.33	800 000	EUR	803 356	830 016	0,02
Silfin NV 2.875% 22 - 11.04.27	400 000	EUR	366 133	374 292	0,01
Solvay SA 2.75% 15 - 02.12.27	900 000	EUR	897 096	883 008	0,02
Syensqo SA FRN 20 - 31.12.99	300 000	EUR	285 801	284 667	0,01
VGP NV 1.50% 21 - 08.04.29	800 000	EUR	683 664	621 336	0,02
VGP NV 1.625% 22 - 17.01.27	700 000	EUR	609 507	613 053	0,02
VGP NV 1.625% 22 - 17.01.27	100 000	EUR	81 998	87 579	0,00
VGP NV 2.25% 22 - 17.01.30	700 000	EUR	599 362	550 676	0,01
VGP NV 2.25% 22 - 17.01.30	100 000	EUR	71 738	78 668	0,00
			68 179 279	68 819 901	1,78
Bermudes					
Athora Holding Ltd. 6.625% 23 - 16.06.28	900 000	EUR	891 434	930 051	0,02
FIL Ltd. 2.50% 16 - 04.11.26	614 000	EUR	587 268	591 853	0,02
			1 478 702	1 521 904	0,04
Îles Vierges britanniques					
Global Switch Holdings Ltd. 2.25% 17 - 31.05.27	899 000	EUR	853 283	874 862	0,02
			853 283	874 862	0,02
Canada					
Alimentation Couche-Tard Inc. 1.875% 16 - 06.05.26	1 324 000	EUR	1 268 706	1 277 753	0,03
Bank of Montreal 2.75% 22 - 15.06.27	1 200 000	EUR	1 161 141	1 180 356	0,03
Bank of Nova Scotia 0.125% 19 - 04.09.26	1 204 000	EUR	1 111 075	1 111 593	0,03
Bank of Nova Scotia 0.25% 21 - 01.11.28	900 000	EUR	783 946	781 227	0,02
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2.75% 18 - 29.03.28	1 158 000	EUR	1 088 491	1 104 141	0,03
Great-West Lifeco Inc. 1.75% 16 - 07.12.26	919 000	EUR	865 841	892 202	0,02
Great-West Lifeco Inc. 4.70% 22 - 16.11.29	600 000	EUR	616 914	643 080	0,02
Magna International Inc. 1.50% 17 - 25.09.27	849 000	EUR	796 355	809 802	0,02
Magna International Inc. 4.375% 23 - 17.03.32	800 000	EUR	804 382	852 784	0,02
Mercedes-Benz Finance Canada Inc. 3.00% 22 - 23.02.27	1 307 000	EUR	1 292 437	1 308 451	0,04
National Bank of Canada 3.75% 23 - 25.01.28	902 000	EUR	881 805	912 905	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Royal Bank of Canada 2.125% 22 - 26.04.29	1 592 000	EUR	1 488 432	1 500 173	0,04
Royal Bank of Canada 4.125% 23 - 05.07.28	1 100 000	EUR	1 098 390	1 135 013	0,03
Royal Bank of Canada 4.375% 23 - 02.10.30	1 390 000	EUR	1 380 734	1 461 154	0,04
Toronto-Dominion Bank 0.50% 22 - 18.01.27	1 304 000	EUR	1 233 994	1 207 282	0,03
Toronto-Dominion Bank 1.952% 22 - 08.04.30	2 100 000	EUR	1 902 045	1 927 695	0,05
Toronto-Dominion Bank 2.551% 22 - 03.08.27	1 600 000	EUR	1 542 545	1 565 424	0,04
Toronto-Dominion Bank 3.129% 22 - 03.08.32	1 836 000	EUR	1 730 239	1 795 718	0,05
Toronto-Dominion Bank 3.631% 22 - 13.12.29	1 936 000	EUR	1 874 345	1 958 729	0,05
TotalEnergies Capital Canada Ltd. 2.125% 14 - 18.09.29	2 100 000	EUR	2 091 843	2 008 797	0,05
			25 013 660	25 434 279	0,66
Îles Caïmans					
CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd. 1.25% 18 - 13.04.25	1 105 000	EUR	1 079 767	1 067 950	0,03
CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd. 2.00% 18 - 13.04.30	800 000	EUR	725 833	725 280	0,02
CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd. 0.75% 21 - 02.11.29	700 000	EUR	609 589	593 929	0,01
CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd. 1.00% 21 - 02.11.33	700 000	EUR	544 900	536 893	0,01
CK Hutchison Finance 16 Ltd. 2.00% 16 - 06.04.28	1 157 000	EUR	1 089 691	1 098 710	0,03
			4 049 780	4 022 762	0,10
Croatie					
Erste & Steiermaerkische Bank FRN 21 - 06.07.28	700 000	EUR	600 398	601 699	0,02
Raiffeisenbank Austria dd FRN 23 - 05.06.27	500 000	EUR	510 092	528 110	0,01
			1 110 490	1 129 809	0,03
République tchèque					
Ceska sporitelna AS FRN 21 - 13.09.28	600 000	EUR	501 063	518 826	0,01
Ceska sporitelna AS FRN 23 - 08.03.28	800 000	EUR	804 446	825 848	0,02
Ceska sporitelna AS FRN 23 - 29.06.27	600 000	EUR	603 715	622 362	0,02
EP Infrastructure AS 1.698% 19 - 30.07.26	1 020 000	EUR	914 664	913 716	0,02
EP Infrastructure AS 1.816% 21 - 02.03.31	693 000	EUR	563 934	535 537	0,02
EP Infrastructure AS 2.045% 19 - 09.10.28	550 000	EUR	478 442	457 127	0,01
EPH Financing International AS 6.651% 23 - 13.11.28	890 000	EUR	890 677	903 839	0,02
Raiffeisenbank AS FRN 21 - 09.06.28	500 000	EUR	396 120	430 220	0,01
Raiffeisenbank AS FRN 23 - 19.01.26	700 000	EUR	707 993	707 539	0,02
			5 861 054	5 915 014	0,15
Danemark					
AP Moller - Maersk A/S 0.75% 21 - 25.11.31	726 000	EUR	580 190	594 652	0,02
AP Moller - Maersk A/S 1.75% 18 - 16.03.26	1 368 000	EUR	1 324 236	1 323 937	0,03
Carlsberg Breweries AS 0.375% 20 - 30.06.27	457 000	EUR	425 459	416 633	0,01
Carlsberg Breweries AS 0.875% 20 - 09.03.30	479 000	EUR	423 859	411 547	0,01
Carlsberg Breweries AS 0.875% 19 - 01.07.29	400 000	EUR	353 667	355 524	0,01
Carlsberg Breweries AS 3.25% 22 - 12.10.25	900 000	EUR	894 362	900 585	0,02
Carlsberg Breweries AS 3.50% 23 - 26.11.26	1 200 000	EUR	1 195 112	1 214 892	0,03
Carlsberg Breweries AS 4.00% 23 - 05.10.28	1 300 000	EUR	1 297 222	1 347 736	0,04
Carlsberg Breweries AS 4.25% 23 - 05.10.33	1 100 000	EUR	1 092 489	1 169 190	0,03
Danica Pension Livsforsikrings AB FRN 15 - 29.09.45	662 000	EUR	652 241	653 791	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Danemark (suite)					
Danske Bank A/S 0.625% 20 - 26.05.25	1 490 000	EUR	1 443 682	1 432 337	0,04
Danske Bank A/S FRN 21 - 09.06.29	498 000	EUR	436 030	440 860	0,01
Danske Bank A/S FRN 21 - 15.05.31	1 458 000	EUR	1 329 851	1 360 431	0,04
Danske Bank A/S FRN 19 - 12.02.30	971 000	EUR	918 501	936 170	0,02
Danske Bank A/S FRN 22 - 17.02.27	966 000	EUR	923 287	920 540	0,02
Danske Bank A/S FRN 20 - 02.09.30	887 000	EUR	831 727	846 012	0,02
Danske Bank A/S FRN 23 - 12.01.27	1 504 000	EUR	1 497 831	1 515 882	0,04
Danske Bank A/S FRN 23 - 10.01.31	1 500 000	EUR	1 495 428	1 554 060	0,04
Danske Bank A/S FRN 23 - 09.11.28	900 000	EUR	907 079	928 710	0,02
Danske Bank A/S FRN 23 - 21.06.30	1 300 000	EUR	1 297 888	1 370 759	0,04
DSV A/S 0.375% 20 - 26.02.27	852 000	EUR	787 780	784 905	0,02
H Lundbeck A/S 0.875% 20 - 14.10.27	636 000	EUR	573 252	576 133	0,02
ISS Global A/S 0.875% 19 - 18.06.26	600 000	EUR	569 598	562 536	0,01
ISS Global A/S 1.50% 17 - 31.08.27	1 021 000	EUR	950 715	953 185	0,03
Jyske Bank A/S FRN 21 - 02.09.26	1 100 000	EUR	1 021 128	1 033 043	0,03
Jyske Bank A/S FRN 21 - 17.02.28	700 000	EUR	617 894	635 362	0,02
Jyske Bank A/S FRN 22 - 11.04.26	600 000	EUR	599 994	605 400	0,02
Jyske Bank A/S FRN 23 - 10.11.29	840 000	EUR	850 475	874 096	0,02
Jyske Bank A/S FRN 23 - 26.10.28	900 000	EUR	901 210	935 784	0,02
Jyske Bank A/S 5.50% 22 - 16.11.27	700 000	EUR	708 583	734 279	0,02
Nykredit Realkredit AS 0.25% 20 - 13.01.26	1 256 000	EUR	1 175 577	1 179 371	0,03
Nykredit Realkredit AS 0.375% 21 - 17.01.28	839 000	EUR	741 029	738 882	0,02
Nykredit Realkredit AS 0.50% 20 - 10.07.25	1 094 000	EUR	1 061 315	1 045 886	0,03
Nykredit Realkredit AS 0.625% 19 - 17.01.25	916 000	EUR	891 709	888 062	0,02
Nykredit Realkredit AS 0.75% 20 - 20.01.27	902 000	EUR	828 874	829 921	0,02
Nykredit Realkredit AS FRN 21 - 28.07.31	600 000	EUR	532 758	547 332	0,01
Nykredit Realkredit AS 1.375% 22 - 12.07.27	979 000	EUR	900 163	916 275	0,02
Nykredit Realkredit AS 4.00% 23 - 17.07.28	1 256 000	EUR	1 222 717	1 271 901	0,03
Nykredit Realkredit AS 4.625% 23 - 19.01.29	1 200 000	EUR	1 211 702	1 240 332	0,03
Nykredit Realkredit AS FRN 22 - 29.12.32	1 000 000	EUR	1 002 881	1 031 810	0,03
Pandora A/S 4.50% 23 - 10.04.28	680 000	EUR	681 670	705 738	0,02
Sydbank AS FRN 21 - 10.11.26	576 000	EUR	541 389	540 242	0,01
Sydbank AS FRN 23 - 06.09.28	900 000	EUR	896 987	929 691	0,02
TDC Net A/S 5.056% 22 - 31.05.28	576 000	EUR	571 337	598 591	0,02
TDC Net A/S 5.618% 23 - 06.02.30	900 000	EUR	886 688	927 297	0,02
TDC Net A/S 6.50% 23 - 01.06.31	700 000	EUR	696 605	741 587	0,02
Vestas Wind Systems A/S 4.125% 23 - 15.06.26	800 000	EUR	802 818	813 336	0,02
Vestas Wind Systems A/S 4.125% 23 - 15.06.31	740 000	EUR	735 682	763 680	0,02
			42 282 671	43 098 905	1,11
Estonie					
Luminor Bank AS FRN 21 - 23.09.26	605 000	EUR	549 935	555 481	0,01
Luminor Bank AS FRN 23 - 16.01.26	301 000	EUR	303 923	306 568	0,01
Luminor Bank AS FRN 23 - 08.06.27	300 000	EUR	305 894	316 191	0,01
			1 159 752	1 178 240	0,03
Finlande					
Balder Finland OYJ 1.00% 21 - 20.01.29	874 000	EUR	704 034	667 194	0,02
Balder Finland OYJ 1.00% 22 - 18.01.27	929 000	EUR	806 346	786 956	0,02
Balder Finland OYJ 1.375% 21 - 24.05.30	695 000	EUR	564 192	504 285	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Balder Finland OYJ 2.00% 22 - 18.01.31	729 000	EUR	558 219	534 167	0,01
Castellum Helsinki Finance Holdings Abp 0.875% 21 - 17.09.29	1 061 000	EUR	835 525	818 381	0,02
Castellum Helsinki Finance Holdings Abp 2.00% 22 - 24.03.25	879 000	EUR	849 344	848 244	0,02
Elenia Verkko OYJ 0.375% 20 - 06.02.27	837 000	EUR	763 134	761 871	0,02
Elisa OYJ 0.25% 20 - 15.09.27	256 000	EUR	227 321	231 944	0,01
Elisa OYJ 1.125% 19 - 26.02.26	373 000	EUR	356 625	357 662	0,01
Elisa OYJ 4.00% 23 - 27.01.29	700 000	EUR	695 870	724 815	0,02
Hemso Treasury OYJ Zero Coupon 21 - 19.01.28	100 000	EUR	82 053	85 636	0,00
Hemso Treasury OYJ Zero Coupon 21 - 19.01.28	740 000	EUR	651 814	633 706	0,02
Kojamo OYJ 0.875% 21 - 28.05.29	476 000	EUR	367 459	376 716	0,01
Kojamo OYJ 1.625% 18 - 07.03.25	876 000	EUR	840 042	838 691	0,02
Kojamo OYJ 1.875% 20 - 27.05.27	907 000	EUR	835 710	810 803	0,02
Kojamo OYJ 2.00% 22 - 31.03.26	400 000	EUR	368 143	373 476	0,01
Metso Outotec OYJ 0.875% 20 - 26.05.28	300 000	EUR	263 444	268 539	0,01
Metso Outotec OYJ 4.875% 22 - 07.12.27	700 000	EUR	711 110	734 587	0,02
Metso OYJ 4.375% 23 - 22.11.30	450 000	EUR	450 574	465 016	0,01
Neste OYJ 0.75% 21 - 25.03.28	900 000	EUR	793 658	816 561	0,02
Neste OYJ 3.875% 23 - 16.03.29	700 000	EUR	702 134	721 497	0,02
Neste OYJ 3.875% 23 - 21.05.31	990 000	EUR	996 904	1 027 016	0,03
Neste OYJ 4.25% 23 - 16.03.33	600 000	EUR	607 255	641 442	0,02
Nokia OYJ 2.00% 19 - 11.03.26	800 000	EUR	763 412	770 664	0,02
Nokia OYJ 3.125% 20 - 15.05.28	600 000	EUR	563 063	586 560	0,02
Nokia OYJ 4.375% 23 - 21.08.31	900 000	EUR	883 284	904 797	0,02
Nordea Bank Abp 0.375% 19 - 28.05.26	970 000	EUR	911 564	911 296	0,02
Nordea Bank Abp 0.50% 20 - 14.05.27	2 069 000	EUR	1 965 878	1 910 101	0,05
Nordea Bank Abp 0.50% 21 - 19.03.31	740 000	EUR	603 261	617 508	0,02
Nordea Bank Abp 0.50% 21 - 02.11.28	1 511 000	EUR	1 314 050	1 327 232	0,03
Nordea Bank Abp 1.125% 15 - 12.02.25	1 797 000	EUR	1 771 611	1 751 410	0,05
Nordea Bank Abp 1.125% 17 - 27.09.27	1 600 000	EUR	1 492 160	1 510 480	0,04
Nordea Bank Abp 1.125% 22 - 16.02.27	1 421 000	EUR	1 348 007	1 334 845	0,03
Nordea Bank Abp 2.50% 22 - 23.05.29	1 553 000	EUR	1 486 176	1 493 567	0,04
Nordea Bank Abp 2.875% 22 - 24.08.32	1 000 000	EUR	925 072	968 820	0,03
Nordea Bank Abp FRN 23 - 10.02.26	1 500 000	EUR	1 490 841	1 496 115	0,04
Nordea Bank Abp 4.125% 23 - 05.05.28	1 500 000	EUR	1 499 289	1 548 525	0,04
Nordea Bank Abp FRN 23 - 06.09.26	1 600 000	EUR	1 598 980	1 620 256	0,04
Nordea Bank Abp FRN 23 - 23.02.34	740 000	EUR	751 957	769 008	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.10% 20 - 16.11.27	1 725 000	EUR	1 558 115	1 536 130	0,04
OP Corporate Bank PLC 0.25% 21 - 24.03.26	740 000	EUR	684 875	691 101	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.375% 21 - 16.06.28	710 000	EUR	639 768	625 886	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.375% 21 - 08.12.28	1 100 000	EUR	928 798	950 950	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.50% 20 - 12.08.25	1 254 000	EUR	1 218 434	1 197 796	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.60% 20 - 18.01.27	800 000	EUR	737 142	733 992	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.625% 19 - 12.11.29	518 000	EUR	421 628	443 957	0,01
OP Corporate Bank PLC 0.625% 22 - 27.07.27	700 000	EUR	636 828	635 726	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.75% 21 - 24.03.31	300 000	EUR	238 695	254 934	0,01
OP Corporate Bank PLC 1.00% 18 - 22.05.25	914 000	EUR	891 508	883 436	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 FRN 20 - 09.06.30	1 415 000	EUR	1 335 610	1 352 287	0,03
OP Corporate Bank PLC 2.875% 22 - 15.12.25	1 900 000	EUR	1 876 865	1 890 481	0,05
OP Corporate Bank PLC 4.00% 23 - 13.06.28	1 100 000	EUR	1 096 949	1 136 553	0,03
OP Corporate Bank PLC 4.125% 22 - 18.04.27	840 000	EUR	842 219	864 083	0,02
Sampo OYJ 1.625% 18 - 21.02.28	300 000	EUR	287 460	289 800	0,01
Sampo OYJ 2.25% 18 - 27.09.30	800 000	EUR	773 557	786 616	0,02
Sampo OYJ FRN 20 - 03.09.52	1 411 000	EUR	1 208 079	1 185 734	0,03
Sampo OYJ FRN 19 - 23.05.49	930 000	EUR	883 482	875 335	0,02
SATO OYJ 1.375% 20 - 24.02.28	528 000	EUR	423 970	440 479	0,01
Stora Enso OYJ 0.625% 20 - 02.12.30	634 000	EUR	518 978	516 120	0,01
Stora Enso OYJ 2.50% 17 - 07.06.27	500 000	EUR	487 980	488 805	0,01
Stora Enso OYJ 2.50% 18 - 21.03.28	600 000	EUR	564 216	577 002	0,01
Stora Enso OYJ 4.00% 23 - 01.06.26	860 000	EUR	859 224	869 864	0,02
Stora Enso OYJ 4.25% 23 - 01.09.29	700 000	EUR	696 166	717 752	0,02
Teollisuuden Voima OYJ 1.125% 19 - 09.03.26	1 100 000	EUR	1 032 198	1 038 653	0,03
Teollisuuden Voima OYJ 1.375% 21 - 23.06.28	700 000	EUR	617 117	633 367	0,02
Teollisuuden Voima OYJ 2.125% 15 - 04.02.25	500 000	EUR	490 553	489 760	0,01
Teollisuuden Voima OYJ 2.625% 22 - 31.03.27	1 100 000	EUR	1 046 255	1 059 707	0,03
Teollisuuden Voima OYJ 4.75% 23 - 01.06.30	1 000 000	EUR	999 357	1 047 470	0,03
UPM-Kymmene OYJ 0.125% 20 - 19.11.28	1 000 000	EUR	893 515	871 250	0,02
UPM-Kymmene OYJ 0.50% 21 - 22.03.31	700 000	EUR	581 665	576 954	0,01
UPM-Kymmene OYJ 2.25% 22 - 23.05.29	776 000	EUR	729 912	741 476	0,02
			59 600 633	59 953 845	1,55
France					
ABEILLE VIE SA d'Assurances Vie et de Capitalisation SA 6.25% 22 - 09.09.33	800 000	EUR	783 513	870 896	0,02
Accor SA 2.375% 21 - 29.11.28	1 100 000	EUR	993 293	1 048 531	0,03
Accor SA 3.00% 19 - 04.02.26	700 000	EUR	662 253	673 064	0,02
Air Liquide Finance SA 0.375% 21 - 27.05.31	600 000	EUR	525 420	506 292	0,01
Air Liquide Finance SA 0.375% 21 - 20.09.33	700 000	EUR	575 934	553 364	0,01
Air Liquide Finance SA 0.625% 19 - 20.06.30	900 000	EUR	774 845	788 445	0,02
Air Liquide Finance SA 1.00% 17 - 08.03.27	700 000	EUR	664 778	666 547	0,02
Air Liquide Finance SA 1.00% 20 - 02.04.25	400 000	EUR	392 723	389 000	0,01
Air Liquide Finance SA 1.25% 15 - 03.06.25	800 000	EUR	785 450	780 144	0,02
Air Liquide Finance SA 1.25% 16 - 13.06.28	1 300 000	EUR	1 239 963	1 237 782	0,03
Air Liquide Finance SA 1.375% 20 - 02.04.30	1 100 000	EUR	1 018 064	1 012 858	0,03
Air Liquide Finance SA 2.875% 22 - 16.09.32	1 100 000	EUR	1 068 557	1 096 623	0,03
ALD SA 1.25% 22 - 02.03.26	1 000 000	EUR	954 832	954 230	0,02
ALD SA 4.00% 22 - 05.07.27	600 000	EUR	602 359	613 134	0,02
ALD SA 4.25% 23 - 18.01.27	1 100 000	EUR	1 103 498	1 124 563	0,03
ALD SA 4.375% 23 - 23.11.26	500 000	EUR	509 448	512 200	0,01
ALD SA 4.75% 22 - 13.10.25	1 200 000	EUR	1 209 434	1 223 364	0,03
ALD SA 4.875% 23 - 06.10.28	1 700 000	EUR	1 707 634	1 799 705	0,05
Alstom SA Zero Coupon 21 - 11.01.29	1 100 000	EUR	964 342	906 070	0,02
Alstom SA 0.125% 21 - 27.07.27	800 000	EUR	722 727	701 936	0,02
Alstom SA 0.25% 19 - 14.10.26	900 000	EUR	844 294	815 274	0,02
Alstom SA 0.50% 21 - 27.07.30	1 200 000	EUR	973 257	972 348	0,03
Altarea SCA 1.75% 20 - 16.01.30	400 000	EUR	311 950	307 788	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Altarea SCA 1.875% 19 - 17.01.28	800 000	EUR	684 500	671 256	0,02
Altareit SCA 2.875% 18 - 02.07.25	400 000	EUR	378 211	383 484	0,01
APRR SA Zero Coupon 21 - 19.06.28	700 000	EUR	634 592	618 975	0,02
APRR SA 0.125% 20 - 18.01.29	700 000	EUR	614 713	611 555	0,02
APRR SA 1.125% 16 - 09.01.26	1 300 000	EUR	1 256 689	1 254 422	0,03
APRR SA 1.25% 16 - 06.01.27	900 000	EUR	875 029	858 474	0,02
APRR SA 1.25% 19 - 18.01.28	800 000	EUR	763 584	752 192	0,02
APRR SA 1.25% 20 - 14.01.27	700 000	EUR	672 590	666 792	0,02
APRR SA 1.50% 17 - 17.01.33	900 000	EUR	851 748	789 381	0,02
APRR SA 1.50% 18 - 25.01.30	900 000	EUR	859 501	829 053	0,02
APRR SA 1.625% 17 - 13.01.32	800 000	EUR	705 403	722 744	0,02
APRR SA 1.875% 14 - 15.01.25	1 000 000	EUR	990 404	981 580	0,03
APRR SA 1.875% 16 - 06.01.31	700 000	EUR	663 636	651 805	0,02
APRR SA 1.875% 22 - 03.01.29	800 000	EUR	756 293	762 048	0,02
APRR SA 3.125% 23 - 24.01.30	900 000	EUR	882 985	907 092	0,02
ARGAN SA 1.011% 21 - 17.11.26	700 000	EUR	631 814	625 240	0,02
Arkema SA 0.125% 20 - 14.10.26	700 000	EUR	640 192	647 353	0,02
Arkema SA 0.75% 19 - 03.12.29	600 000	EUR	538 987	524 388	0,01
Arkema SA 1.50% 15 - 20.01.25	900 000	EUR	890 056	880 605	0,02
Arkema SA 1.50% 17 - 20.04.27	1 500 000	EUR	1 443 768	1 428 885	0,04
Arkema SA FRN 20 - 31.12.99	500 000	EUR	445 394	462 500	0,01
Arkema SA 3.50% 23 - 23.01.31	600 000	EUR	582 882	601 236	0,02
Arkema SA 4.25% 23 - 20.05.30	1 000 000	EUR	1 012 726	1 044 000	0,03
Arval Service Lease SA Zero Coupon 21 - 01.10.25	1 000 000	EUR	939 719	940 420	0,02
Arval Service Lease SA 0.875% 22 - 17.02.25	1 000 000	EUR	975 502	966 770	0,03
Arval Service Lease SA 3.375% 22 - 04.01.26	900 000	EUR	888 149	899 073	0,02
Arval Service Lease SA 4.00% 22 - 22.09.26	1 000 000	EUR	991 547	1 012 810	0,03
Arval Service Lease SA 4.125% 23 - 13.04.26	1 200 000	EUR	1 199 012	1 214 184	0,03
Arval Service Lease SA 4.25% 23 - 11.11.25	1 300 000	EUR	1 299 420	1 314 742	0,03
Arval Service Lease SA 4.75% 22 - 22.05.27	900 000	EUR	916 486	933 813	0,02
Autoroutes du Sud de la France SA 1.00% 16 - 13.05.26	1 000 000	EUR	952 275	955 390	0,02
Autoroutes du Sud de la France SA 1.125% 17 - 20.04.26	600 000	EUR	583 088	575 784	0,01
Autoroutes du Sud de la France SA 1.25% 17 - 18.01.27	1 400 000	EUR	1 351 420	1 335 810	0,03
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 22.01.30	1 500 000	EUR	1 388 778	1 378 440	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 27.06.28	1 100 000	EUR	1 053 864	1 036 805	0,03
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 19 - 21.02.31	1 600 000	EUR	1 465 081	1 437 712	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 2.75% 22 - 02.09.32	1 400 000	EUR	1 330 794	1 358 798	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 3.25% 23 - 19.01.33	1 100 000	EUR	1 064 186	1 106 215	0,03
AXA SA 1.125% 16 - 15.05.28	600 000	EUR	557 092	563 208	0,01
AXA SA FRN 21 - 07.10.41	1 500 000	EUR	1 225 103	1 238 940	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
AXA SA FRN 22 - 10.07.42	1 822 000	EUR	1 512 773	1 498 540	0,04
AXA SA FRN 18 - 28.05.49	3 012 000	EUR	2 910 299	2 888 327	0,07
AXA SA FRN 16 - 06.07.47	2 300 000	EUR	2 270 956	2 251 700	0,06
AXA SA 3.625% 23 - 10.01.33	1 250 000	EUR	1 234 031	1 323 325	0,03
AXA SA 3.75% 22 - 12.10.30	1 250 000	EUR	1 265 740	1 318 250	0,03
AXA SA FRN 14 - 20.05.49	1 450 000	EUR	1 461 563	1 430 729	0,04
AXA SA FRN 22 - 10.03.43	1 800 000	EUR	1 698 863	1 777 320	0,05
AXA SA FRN 23 - 11.07.43	1 500 000	EUR	1 492 745	1 606 470	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 21 - 11.05.26	2 400 000	EUR	2 249 248	2 230 032	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 21 - 07.03.25	2 500 000	EUR	2 424 026	2 395 325	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.10% 20 - 08.10.27	1 200 000	EUR	1 106 970	1 074 852	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 21 - 19.07.28	1 500 000	EUR	1 331 203	1 298 460	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 21 - 29.06.28	1 300 000	EUR	1 134 829	1 145 027	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 20 - 21.02.31	1 900 000	EUR	1 640 850	1 555 112	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 21 - 03.11.28	2 200 000	EUR	1 933 609	1 924 340	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 22 - 19.11.27	900 000	EUR	819 793	809 820	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 18 - 17.07.25	2 300 000	EUR	2 239 299	2 205 999	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 19 - 08.06.26	2 800 000	EUR	2 663 053	2 635 192	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 20 - 17.01.30	1 900 000	EUR	1 618 444	1 608 198	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.00% 22 - 23.05.25	2 500 000	EUR	2 427 077	2 415 825	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.125% 21 - 19.11.31	1 200 000	EUR	929 845	970 272	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.125% 22 - 19.01.32	2 000 000	EUR	1 677 007	1 666 980	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 15 - 14.01.25	1 600 000	EUR	1 569 213	1 559 504	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 17 - 26.05.27	1 800 000	EUR	1 706 657	1 688 346	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 20 - 03.06.30	1 300 000	EUR	1 135 437	1 123 941	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.375% 18 - 16.07.28	1 600 000	EUR	1 503 890	1 486 384	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 16 - 19.01.26	1 800 000	EUR	1 762 992	1 740 060	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 17 - 15.11.27	900 000	EUR	826 357	836 019	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.75% 19 - 15.03.29	1 500 000	EUR	1 421 902	1 372 440	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 16 - 04.11.26	1 100 000	EUR	1 051 148	1 052 865	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 19 - 18.06.29	1 500 000	EUR	1 362 790	1 368 420	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.125% 16 - 12.09.26	700 000	EUR	667 840	676 333	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.375% 16 - 24.03.26	1 600 000	EUR	1 562 008	1 564 560	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.50% 18 - 25.05.28	600 000	EUR	562 691	575 634	0,01
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 17 - 31.03.27	700 000	EUR	678 697	680 120	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 22 - 06.11.29	1 300 000	EUR	1 234 951	1 235 286	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 15 - 11.09.25	1 600 000	EUR	1 582 364	1 588 128	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.125% 22 - 14.09.27	2 400 000	EUR	2 347 947	2 391 864	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.625% 22 - 14.09.32	1 200 000	EUR	1 164 119	1 215 456	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.75% 22 - 01.02.33	2 400 000	EUR	2 360 006	2 449 872	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 22 - 16.06.32	1 800 000	EUR	1 724 033	1 777 914	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.875% 23 - 26.01.28	1 700 000	EUR	1 671 734	1 725 075	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.875% 23 - 14.02.28	900 000	EUR	892 647	923 202	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 22 - 21.11.29	1 100 000	EUR	1 107 919	1 139 325	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 23 - 26.01.33	900 000	EUR	899 001	923 715	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.125% 23 - 13.03.29	2 200 000	EUR	2 209 035	2 283 688	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.125% 23 - 14.06.33	1 900 000	EUR	1 875 262	1 993 119	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.125% 23 - 18.09.30	1 200 000	EUR	1 195 688	1 260 096	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.375% 23 - 02.05.30	1 800 000	EUR	1 800 922	1 869 282	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.75% 23 - 10.11.31	1 700 000	EUR	1 759 166	1 804 363	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 5.125% 23 - 13.01.33	1 900 000	EUR	1 884 338	2 034 178	0,05
Banque Stellantis France SACA Zero Coupon 21 - 22.01.25	900 000	EUR	869 492	865 521	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Stellantis France SACA 3.875% 23 - 19.01.26	900 000	EUR	897 503	906 678	0,02
Banque Stellantis France SACA 4.00% 23 - 21.01.27	600 000	EUR	597 129	610 002	0,02
BNP Paribas Cardif SA FRN 14 - 29.11.49	1 600 000	EUR	1 601 601	1 576 640	0,04
BNP Paribas SA 0.125% 19 - 04.09.26	1 600 000	EUR	1 478 520	1 476 576	0,04
BNP Paribas SA FRN 21 - 13.04.27	1 900 000	EUR	1 761 642	1 763 219	0,05
BNP Paribas SA FRN 20 - 14.10.27	1 000 000	EUR	919 269	922 510	0,02
BNP Paribas SA FRN 19 - 04.06.26	1 200 000	EUR	1 149 945	1 147 680	0,03
BNP Paribas SA FRN 20 - 19.02.28	2 000 000	EUR	1 806 303	1 819 940	0,05
BNP Paribas SA FRN 20 - 01.09.28	1 400 000	EUR	1 263 449	1 255 912	0,03
BNP Paribas SA FRN 21 - 19.01.30	1 400 000	EUR	1 201 583	1 200 668	0,03
BNP Paribas SA FRN 21 - 30.05.28	1 500 000	EUR	1 390 963	1 358 190	0,04
BNP Paribas SA 0.625% 20 - 03.12.32	2 700 000	EUR	2 105 590	2 103 354	0,05
BNP Paribas SA FRN 21 - 31.08.33	1 600 000	EUR	1 328 431	1 373 056	0,04
BNP Paribas SA FRN 22 - 11.07.30	2 300 000	EUR	2 008 016	1 982 370	0,05
BNP Paribas SA 1.125% 18 - 11.06.26	2 000 000	EUR	1 915 659	1 903 840	0,05
BNP Paribas SA FRN 20 - 15.01.32	1 400 000	EUR	1 268 881	1 276 618	0,03
BNP Paribas SA FRN 20 - 17.04.29	1 800 000	EUR	1 662 599	1 624 788	0,04
BNP Paribas SA 1.25% 18 - 19.03.25	1 295 000	EUR	1 266 276	1 259 336	0,03
BNP Paribas SA 1.375% 19 - 28.05.29	2 300 000	EUR	2 092 032	2 068 436	0,05
BNP Paribas SA 1.50% 16 - 25.05.28	1 263 000	EUR	1 250 681	1 195 493	0,03
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 17.11.25	1 997 000	EUR	1 944 528	1 935 413	0,05
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 23.05.28	1 650 000	EUR	1 525 936	1 546 578	0,04
BNP Paribas SA 1.625% 16 - 23.02.26	1 498 000	EUR	1 457 003	1 452 596	0,04
BNP Paribas SA 1.625% 19 - 02.07.31	1 800 000	EUR	1 481 842	1 537 200	0,04
BNP Paribas SA 2.10% 22 - 07.04.32	2 100 000	EUR	1 819 436	1 875 678	0,05
BNP Paribas SA FRN 19 - 23.01.27	3 400 000	EUR	3 351 110	3 303 236	0,09
BNP Paribas SA 2.25% 16 - 11.01.27	1 600 000	EUR	1 560 685	1 554 640	0,04
BNP Paribas SA 2.375% 15 - 17.02.25	2 000 000	EUR	1 987 108	1 971 720	0,05
BNP Paribas SA FRN 18 - 20.11.30	800 000	EUR	762 891	776 832	0,02
BNP Paribas SA FRN 22 - 31.03.32	2 300 000	EUR	2 148 098	2 176 835	0,06
BNP Paribas SA 2.75% 15 - 27.01.26	1 029 000	EUR	1 020 156	1 019 811	0,03
BNP Paribas SA FRN 22 - 25.07.28	2 100 000	EUR	2 030 345	2 044 896	0,05
BNP Paribas SA 2.875% 16 - 01.10.26	1 100 000	EUR	1 082 631	1 087 933	0,03
BNP Paribas SA 3.625% 22 - 01.09.29	2 100 000	EUR	2 045 240	2 107 686	0,05
BNP Paribas SA FRN 23 - 10.01.31	1 900 000	EUR	1 903 617	1 956 335	0,05
BNP Paribas SA FRN 23 - 23.02.29	1 600 000	EUR	1 580 777	1 636 400	0,04
BNP Paribas SA 4.125% 23 - 24.05.33	1 800 000	EUR	1 796 829	1 897 740	0,05
BNP Paribas SA FRN 23 - 26.09.32	2 200 000	EUR	2 179 063	2 304 324	0,06
BNP Paribas SA FRN 23 - 13.04.31	1 500 000	EUR	1 481 455	1 551 225	0,04
BNP Paribas SA FRN 23 - 13.01.29	1 500 000	EUR	1 518 750	1 552 980	0,04
BNP Paribas SA FRN 23 - 13.11.32	2 400 000	EUR	2 487 878	2 546 184	0,07
Bouygues SA 0.50% 21 - 11.02.30	1 400 000	EUR	1 180 341	1 215 116	0,03
Bouygues SA 1.125% 20 - 24.07.28	1 600 000	EUR	1 497 245	1 490 944	0,04
Bouygues SA 1.375% 16 - 07.06.27	1 100 000	EUR	1 039 540	1 047 420	0,03
Bouygues SA 2.25% 22 - 29.06.29	1 600 000	EUR	1 521 652	1 546 688	0,04
Bouygues SA 3.25% 22 - 30.06.37	1 400 000	EUR	1 290 083	1 369 732	0,04
Bouygues SA 3.875% 23 - 17.07.31	1 700 000	EUR	1 694 906	1 773 049	0,05
Bouygues SA 4.625% 22 - 07.06.32	1 800 000	EUR	1 863 945	1 977 426	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Bouygues SA 5.375% 22 - 30.06.42	1 500 000	EUR	1 582 822	1 782 135	0,05
BPCE SA 0.01% 21 - 14.01.27	1 200 000	EUR	1 103 468	1 093 788	0,03
BPCE SA 0.25% 20 - 15.01.26	2 000 000	EUR	1 914 436	1 879 800	0,05
BPCE SA 0.25% 21 - 14.01.31	2 000 000	EUR	1 622 769	1 610 200	0,04
BPCE SA 0.375% 22 - 02.02.26	1 600 000	EUR	1 539 330	1 508 224	0,04
BPCE SA 0.50% 19 - 24.02.27	1 600 000	EUR	1 461 877	1 464 960	0,04
BPCE SA FRN 20 - 15.09.27	1 900 000	EUR	1 759 233	1 752 902	0,05
BPCE SA FRN 22 - 14.01.28	1 300 000	EUR	1 196 550	1 186 614	0,03
BPCE SA 0.625% 20 - 15.01.30	900 000	EUR	784 778	770 715	0,02
BPCE SA 0.625% 20 - 28.04.25	2 200 000	EUR	2 144 667	2 118 380	0,05
BPCE SA 0.75% 21 - 03.03.31	1 200 000	EUR	1 082 631	995 700	0,03
BPCE SA 1.00% 16 - 05.10.28	1 200 000	EUR	1 132 433	1 096 620	0,03
BPCE SA 1.00% 19 - 01.04.25	1 300 000	EUR	1 276 491	1 259 557	0,03
BPCE SA 1.00% 22 - 14.01.32	1 400 000	EUR	1 194 442	1 154 482	0,03
BPCE SA 1.375% 18 - 23.03.26	1 300 000	EUR	1 251 307	1 247 324	0,03
BPCE SA 1.625% 18 - 31.01.28	900 000	EUR	834 205	841 833	0,02
BPCE SA FRN 22 - 02.03.29	1 300 000	EUR	1 192 216	1 200 563	0,03
BPCE SA FRN 22 - 02.02.34	1 500 000	EUR	1 193 662	1 320 915	0,03
BPCE SA 1.75% 22 - 26.04.27	1 400 000	EUR	1 328 331	1 340 192	0,03
BPCE SA FRN 22 - 02.03.32	600 000	EUR	551 508	561 786	0,01
BPCE SA 2.375% 22 - 26.04.32	900 000	EUR	798 638	836 703	0,02
BPCE SA 2.875% 16 - 22.04.26	1 100 000	EUR	1 077 740	1 088 241	0,03
BPCE SA 3.50% 23 - 25.01.28	2 100 000	EUR	2 068 698	2 123 184	0,05
BPCE SA 3.625% 23 - 17.04.26	1 700 000	EUR	1 693 239	1 714 620	0,04
BPCE SA 4.00% 22 - 29.11.32	2 200 000	EUR	2 177 980	2 298 428	0,06
BPCE SA 4.125% 23 - 10.07.28	700 000	EUR	702 574	725 942	0,02
BPCE SA 4.375% 23 - 13.07.28	1 600 000	EUR	1 599 177	1 654 016	0,04
BPCE SA 4.50% 23 - 13.01.33	1 800 000	EUR	1 815 915	1 891 584	0,05
BPCE SA FRN 23 - 02.03.30	1 600 000	EUR	1 598 515	1 672 000	0,04
BPCE SA FRN 23 - 14.06.34	1 200 000	EUR	1 198 535	1 276 080	0,03
BPCE SA FRN 23 - 25.01.35	2 200 000	EUR	2 153 473	2 262 656	0,06
BPCE SA FRN 23 - 01.06.33	1 000 000	EUR	1 007 322	1 056 910	0,03
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 0.75% 21 - 07.07.28	800 000	EUR	704 252	709 616	0,02
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 2.125% 19 - 16.09.29	900 000	EUR	795 938	823 185	0,02
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 3.375% 18 - 24.09.28	600 000	EUR	590 242	595 080	0,02
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 6.00% 17 - 23.01.27	900 000	EUR	957 467	966 924	0,03
Capgemini SE 0.625% 20 - 23.06.25	1 500 000	EUR	1 445 177	1 441 005	0,04
Capgemini SE 1.125% 20 - 23.06.30	1 100 000	EUR	1 004 639	982 245	0,03
Capgemini SE 1.625% 20 - 15.04.26	1 500 000	EUR	1 453 911	1 452 570	0,04
Capgemini SE 1.75% 18 - 18.04.28	1 100 000	EUR	1 055 210	1 049 125	0,03
Capgemini SE 2.00% 20 - 15.04.29	1 100 000	EUR	1 001 177	1 052 623	0,03
Capgemini SE 2.00% 20 - 15.04.29	100 000	EUR	90 557	95 693	0,00
Capgemini SE 2.375% 20 - 15.04.32	1 700 000	EUR	1 672 047	1 610 342	0,04
Carmila SA 1.625% 20 - 30.05.27	400 000	EUR	366 616	369 796	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Carmila SA 1.625% 21 - 01.04.29	400 000	EUR	351 098	345 504	0,01
Carmila SA 2.125% 18 - 07.03.28	300 000	EUR	272 140	278 091	0,01
Carmila SA 5.50% 23 - 09.10.28	1 000 000	EUR	993 998	1 037 520	0,03
Carrefour Banque SA 0.107% 21 - 14.06.25	800 000	EUR	760 155	762 272	0,02
Carrefour Banque SA 4.079% 23 - 05.05.27	800 000	EUR	796 313	812 336	0,02
Carrefour SA 1.00% 19 - 17.05.27	600 000	EUR	551 092	560 484	0,01
Carrefour SA 1.25% 15 - 03.06.25	1 300 000	EUR	1 264 008	1 261 130	0,03
Carrefour SA 1.75% 18 - 04.05.26	600 000	EUR	583 987	581 940	0,02
Carrefour SA 1.875% 22 - 30.10.26	1 300 000	EUR	1 260 421	1 256 658	0,03
Carrefour SA 2.375% 22 - 30.10.29	1 000 000	EUR	952 123	958 370	0,02
Carrefour SA 2.625% 20 - 15.12.27	1 400 000	EUR	1 379 845	1 373 134	0,04
Carrefour SA 3.75% 23 - 10.10.30	1 000 000	EUR	969 665	1 020 770	0,03
Carrefour SA 4.125% 22 - 12.10.28	1 100 000	EUR	1 108 608	1 144 550	0,03
Carrefour SA 4.375% 23 - 14.11.31	1 100 000	EUR	1 123 661	1 166 341	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.00% 17 - 17.03.25	1 200 000	EUR	1 171 806	1 167 528	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.125% 18 - 23.03.26	1 300 000	EUR	1 246 237	1 245 257	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.375% 17 - 14.06.27	1 200 000	EUR	1 149 438	1 138 008	0,03
Cie de Saint-Gobain 1.625% 22 - 10.08.25	900 000	EUR	877 041	876 249	0,02
Cie de Saint-Gobain 1.875% 18 - 21.09.28	1 000 000	EUR	951 272	951 270	0,02
Cie de Saint-Gobain 1.875% 19 - 15.03.31	1 800 000	EUR	1 648 643	1 661 256	0,04
Cie de Saint-Gobain 2.125% 22 - 10.06.28	900 000	EUR	847 317	864 630	0,02
Cie de Saint-Gobain 2.375% 20 - 04.10.27	1 100 000	EUR	1 097 911	1 078 550	0,03
Cie de Saint-Gobain 2.625% 22 - 10.08.32	600 000	EUR	552 095	575 982	0,01
Cie de Saint-Gobain 3.50% 23 - 18.01.29	1 200 000	EUR	1 185 482	1 225 500	0,03
Cie de Saint-Gobain SA 3.75% 23 - 29.11.26	1 100 000	EUR	1 104 756	1 118 359	0,03
Cie de Saint-Gobain SA 3.875% 23 - 29.11.30	1 200 000	EUR	1 201 629	1 240 044	0,03
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 0.75% 16 - 09.09.28	1 000 000	EUR	930 107	916 550	0,02
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.00% 20 - 19.05.31	1 500 000	EUR	1 341 422	1 299 000	0,03
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.125% 17 - 13.10.27	1 100 000	EUR	1 036 806	1 035 100	0,03
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA Zero Coupon 20 - 02.11.28	800 000	EUR	699 408	705 624	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.25% 20 - 02.11.32	700 000	EUR	543 273	562 324	0,01
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.625% 20 - 02.11.40	700 000	EUR	442 984	474 628	0,01
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.875% 18 - 03.09.25	1 400 000	EUR	1 355 611	1 348 550	0,03
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 15 - 28.05.27	716 000	EUR	688 898	690 160	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 18 - 03.09.30	1 500 000	EUR	1 460 374	1 400 895	0,04
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 2.50% 18 - 03.09.38	1 000 000	EUR	933 304	933 640	0,02
Coface SA 5.75% 23 - 28.11.33	500 000	EUR	499 824	518 495	0,01
Coface SA 6.00% 22 - 22.09.32	400 000	EUR	399 656	426 944	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Cofiroute SA 0.375% 16 - 07.02.25	1 000 000	EUR	975 218	966 450	0,03
Covivio 1.125% 19 - 17.09.31	1 100 000	EUR	934 681	905 113	0,02
Covivio 1.50% 17 - 21.06.27	700 000	EUR	653 594	657 503	0,02
Covivio 1.625% 20 - 23.06.30	900 000	EUR	792 780	797 841	0,02
Covivio 1.875% 16 - 20.05.26	900 000	EUR	869 064	866 448	0,02
Covivio 2.375% 18 - 20.02.28	193 000	EUR	197 686	184 687	0,00
Covivio Hotels SACA 1.00% 21 - 27.07.29	900 000	EUR	786 775	786 177	0,02
Covivio Hotels SACA 1.875% 18 - 24.09.25	500 000	EUR	474 696	482 210	0,01
Covivio SA 4.625% 23 - 05.06.32	700 000	EUR	705 533	725 319	0,02
Credit Agricole Assurances SA 1.50% 21 - 06.10.31	1 600 000	EUR	1 316 269	1 305 152	0,03
Credit Agricole Assurances SA 2.00% 20 - 17.07.30	1 400 000	EUR	1 222 734	1 228 430	0,03
Credit Agricole Assurances SA FRN 18 - 29.01.48	1 400 000	EUR	1 302 855	1 301 398	0,03
Credit Agricole Assurances SA FRN 15 - 31.12.99	1 100 000	EUR	1 114 955	1 093 763	0,03
Credit Agricole Assurances SA FRN 14 - 31.10.49	900 000	EUR	913 658	895 833	0,02
Credit Agricole Assurances SA FRN 16 - 27.09.48	1 400 000	EUR	1 444 605	1 410 752	0,04
Credit Agricole Assurances SA 5.875% 23 - 25.10.33	800 000	EUR	802 883	878 952	0,02
Credit Agricole SA 0.125% 20 - 09.12.27	1 700 000	EUR	1 528 601	1 508 274	0,04
Credit Agricole SA 0.375% 19 - 21.10.25	1 200 000	EUR	1 155 687	1 143 612	0,03
Credit Agricole SA 0.375% 21 - 20.04.28	1 700 000	EUR	1 513 741	1 501 899	0,04
Credit Agricole SA FRN 21 - 21.09.29	1 300 000	EUR	1 138 625	1 134 211	0,03
Credit Agricole SA FRN 22 - 12.01.28	1 300 000	EUR	1 198 976	1 195 467	0,03
Credit Agricole SA 0.875% 20 - 14.01.32	1 900 000	EUR	1 591 822	1 562 712	0,04
Credit Agricole SA 1.00% 19 - 03.07.29	1 500 000	EUR	1 375 879	1 336 815	0,03
Credit Agricole SA FRN 20 - 22.04.26	2 100 000	EUR	2 031 844	2 026 290	0,05
Credit Agricole SA 1.00% 22 - 18.09.25	2 000 000	EUR	1 925 004	1 931 480	0,05
Credit Agricole SA 1.125% 22 - 12.07.32	1 500 000	EUR	1 227 140	1 257 255	0,03
Credit Agricole SA 1.125% 22 - 24.02.29	1 500 000	EUR	1 385 883	1 366 275	0,04
Credit Agricole SA 1.25% 16 - 14.04.26	2 300 000	EUR	2 224 093	2 204 021	0,06
Credit Agricole SA 1.375% 17 - 03.05.27	2 400 000	EUR	2 298 861	2 274 288	0,06
Credit Agricole SA 1.375% 18 - 13.03.25	1 500 000	EUR	1 465 646	1 462 815	0,04
Credit Agricole SA FRN 20 - 05.06.30	1 200 000	EUR	1 147 131	1 159 488	0,03
Credit Agricole SA 1.75% 19 - 05.03.29	2 200 000	EUR	2 084 544	2 031 854	0,05
Credit Agricole SA 1.875% 16 - 20.12.26	2 300 000	EUR	2 232 357	2 214 233	0,06
Credit Agricole SA FRN 22 - 22.04.27	900 000	EUR	868 966	867 942	0,02
Credit Agricole SA 2.00% 19 - 25.03.29	1 700 000	EUR	1 556 470	1 576 223	0,04
Credit Agricole SA 2.50% 22 - 22.04.34	1 300 000	EUR	1 129 690	1 195 012	0,03
Credit Agricole SA 2.50% 22 - 29.08.29	1 800 000	EUR	1 702 385	1 735 290	0,04
Credit Agricole SA 2.625% 15 - 17.03.27	2 930 000	EUR	2 871 322	2 842 129	0,07
Credit Agricole SA 3.125% 14 - 05.02.26	1 400 000	EUR	1 414 977	1 402 884	0,04
Credit Agricole SA 3.125% 14 - 05.02.26	100 000	EUR	98 937	100 206	0,00
Credit Agricole SA 3.375% 22 - 28.07.27	1 400 000	EUR	1 385 415	1 409 800	0,04
Credit Agricole SA 3.875% 22 - 28.11.34	2 200 000	EUR	2 155 325	2 303 532	0,06
Credit Agricole SA 3.875% 23 - 20.04.31	2 200 000	EUR	2 183 977	2 273 700	0,06
Credit Agricole SA FRN 22 - 12.10.26	1 600 000	EUR	1 596 667	1 613 088	0,04
Credit Agricole SA 4.00% 23 - 18.01.33	1 400 000	EUR	1 413 790	1 472 408	0,04
Credit Agricole SA 4.125% 23 - 07.03.30	1 500 000	EUR	1 530 660	1 566 705	0,04
Credit Agricole SA FRN 23 - 11.07.29	1 700 000	EUR	1 702 046	1 753 924	0,05
Credit Agricole SA 4.375% 23 - 27.11.33	1 700 000	EUR	1 727 365	1 785 238	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Agricole SA FRN 23 - 28.08.33	1 600 000	EUR	1 601 955	1 680 000	0,04
Credit Logement SA FRN 21 - 15.02.34	700 000	EUR	590 195	608 482	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.01% 20 - 28.01.26	900 000	EUR	841 736	842 985	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.375% 19 - 03.10.28	900 000	EUR	796 908	787 635	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.75% 22 - 18.01.30	1 000 000	EUR	875 689	859 420	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 20 - 07.05.27	1 400 000	EUR	1 295 315	1 295 014	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 21 - 11.03.33	900 000	EUR	699 773	715 140	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 21 - 25.10.31	700 000	EUR	557 393	575 134	0,01
Credit Mutuel Arkea SA 1.125% 19 - 23.05.29	900 000	EUR	783 404	805 716	0,02
Credit Mutuel Arkea SA FRN 20 - 11.06.29	1 200 000	EUR	1 071 987	1 089 360	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 1.375% 19 - 17.01.25	700 000	EUR	693 117	683 872	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 1.625% 19 - 15.04.26	800 000	EUR	771 504	769 408	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 3.25% 16 - 01.06.26	700 000	EUR	692 225	701 372	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 19 - 11.03.31	900 000	EUR	881 006	866 844	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 22 - 19.09.27	1 500 000	EUR	1 467 788	1 506 165	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 3.50% 17 - 09.02.29	700 000	EUR	688 174	691 691	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 3.875% 23 - 22.05.28	800 000	EUR	798 152	817 592	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 4.125% 23 - 02.04.31	900 000	EUR	889 137	943 038	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 4.125% 23 - 01.02.34	1 000 000	EUR	1 013 264	1 051 260	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 4.25% 22 - 01.12.32	800 000	EUR	802 293	840 816	0,02
Danone SA Zero Coupon 21 - 01.12.25	1 600 000	EUR	1 519 540	1 510 688	0,04
Danone SA 0.395% 20 - 10.06.29	1 300 000	EUR	1 163 345	1 142 453	0,03
Danone SA 0.52% 21 - 09.11.30	1 400 000	EUR	1 198 057	1 188 306	0,03
Danone SA 0.571% 20 - 17.03.27	1 000 000	EUR	965 290	938 260	0,02
Danone SA 1.00% 18 - 26.03.25	400 000	EUR	389 494	388 644	0,01
Danone SA FRN 21 - 31.12.99	600 000	EUR	527 771	548 238	0,01
Danone SA 1.125% 15 - 14.01.25	1 000 000	EUR	992 839	974 650	0,03
Danone SA 1.208% 16 - 03.11.28	2 400 000	EUR	2 300 211	2 236 152	0,06
Danone SA 3.071% 22 - 07.09.32	800 000	EUR	779 269	796 904	0,02
Danone SA 3.47% 23 - 22.05.31	1 100 000	EUR	1 095 944	1 129 381	0,03
Danone SA 3.706% 23 - 13.11.29	1 200 000	EUR	1 210 247	1 250 712	0,03
Dassault Systemes SE 0.125% 19 - 16.09.26	1 100 000	EUR	1 044 503	1 025 167	0,03
Dassault Systemes SE 0.375% 19 - 16.09.29	1 700 000	EUR	1 531 018	1 497 683	0,04
Edenred 1.375% 15 - 10.03.25	900 000	EUR	878 587	877 680	0,02
Edenred 1.375% 20 - 18.06.29	800 000	EUR	728 829	735 744	0,02
Edenred 1.875% 17 - 30.03.27	800 000	EUR	781 981	771 728	0,02
Edenred 1.875% 18 - 06.03.26	1 000 000	EUR	979 317	973 820	0,03
Edenred 3.625% 23 - 13.12.26	1 000 000	EUR	994 718	1 013 760	0,03
Edenred 3.625% 23 - 13.06.31	900 000	EUR	890 584	915 606	0,02
Elis SA 1.00% 19 - 03.04.25	300 000	EUR	287 784	288 741	0,01
ELO SACA 2.375% 19 - 25.04.25	900 000	EUR	881 688	878 697	0,02
ELO SACA 2.875% 20 - 29.01.26	1 300 000	EUR	1 289 398	1 264 276	0,03
ELO SACA 3.25% 20 - 23.07.27	900 000	EUR	898 232	873 504	0,02
ELO SACA 4.875% 22 - 08.12.28	900 000	EUR	870 047	891 126	0,02
ELO SACA 6.00% 23 - 22.03.29	1 300 000	EUR	1 290 184	1 320 878	0,03
Engie SA Zero Coupon 19 - 04.03.27	900 000	EUR	840 162	817 776	0,02
Engie SA 0.375% 19 - 21.06.27	900 000	EUR	841 064	821 655	0,02
Engie SA 0.375% 20 - 11.06.27	900 000	EUR	832 819	822 204	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.375% 21 - 26.10.29	1 100 000	EUR	961 110	940 632	0,02
Engie SA 0.50% 19 - 24.10.30	1 300 000	EUR	1 111 017	1 086 111	0,03
Engie SA 0.875% 18 - 19.09.25	800 000	EUR	766 713	770 096	0,02
Engie SA 1.00% 15 - 13.03.26	1 100 000	EUR	1 067 019	1 045 572	0,03
Engie SA 1.00% 21 - 26.10.36	1 100 000	EUR	806 205	817 927	0,02
Engie SA 1.25% 19 - 24.10.41	900 000	EUR	608 822	600 705	0,02
Engie SA 1.375% 17 - 28.02.29	1 100 000	EUR	1 029 883	1 012 759	0,03
Engie SA 1.375% 18 - 22.06.28	1 400 000	EUR	1 299 048	1 302 392	0,03
Engie SA 1.375% 19 - 21.06.39	1 100 000	EUR	883 257	798 215	0,02
Engie SA 1.375% 20 - 27.03.25	800 000	EUR	789 514	780 672	0,02
Engie SA 1.50% 15 - 13.03.35	800 000	EUR	657 382	650 528	0,02
Engie SA 1.50% 17 - 27.03.28	1 000 000	EUR	958 389	941 010	0,02
Engie SA FRN 20 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 274 651	1 321 215	0,03
Engie SA FRN 19 - 31.12.99	600 000	EUR	565 971	576 810	0,01
Engie SA 1.75% 20 - 27.03.28	1 000 000	EUR	959 988	948 670	0,02
Engie SA 1.875% 18 - 19.09.33	600 000	EUR	508 192	529 980	0,01
Engie SA FRN 21 - 31.12.99	1 100 000	EUR	899 566	912 758	0,02
Engie SA 2.00% 17 - 28.09.37	1 200 000	EUR	1 014 270	998 244	0,03
Engie SA 2.125% 20 - 30.03.32	900 000	EUR	864 553	825 705	0,02
Engie SA 2.375% 14 - 19.05.26	1 600 000	EUR	1 621 654	1 567 568	0,04
Engie SA FRN 19 - 31.12.99	1 300 000	EUR	1 302 706	1 282 112	0,03
Engie SA 3.50% 22 - 27.09.29	1 000 000	EUR	989 700	1 017 260	0,03
Engie SA 3.625% 23 - 11.01.30	1 700 000	EUR	1 683 028	1 745 883	0,05
Engie SA 3.625% 23 - 06.12.26	700 000	EUR	700 055	709 877	0,02
Engie SA 3.75% 23 - 06.09.27	1 000 000	EUR	996 192	1 020 410	0,03
Engie SA 3.875% 23 - 06.01.31	1 500 000	EUR	1 484 856	1 550 475	0,04
Engie SA 3.875% 23 - 06.12.33	1 400 000	EUR	1 397 675	1 447 110	0,04
Engie SA 4.00% 23 - 11.01.35	1 800 000	EUR	1 784 236	1 870 002	0,05
Engie SA 4.25% 23 - 11.01.43	1 200 000	EUR	1 183 554	1 256 148	0,03
Engie SA 4.25% 23 - 06.09.34	1 300 000	EUR	1 303 877	1 378 390	0,04
Engie SA 4.50% 23 - 06.09.42	1 300 000	EUR	1 297 217	1 400 165	0,04
Engie SA 5.95% 11 - 16.03.11	409 000	EUR	581 958	521 524	0,01
EssilorLuxottica SA 0.125% 19 - 27.05.25	2 200 000	EUR	2 139 202	2 102 870	0,05
EssilorLuxottica SA 0.375% 19 - 27.11.27	2 400 000	EUR	2 232 187	2 195 184	0,06
EssilorLuxottica SA 0.375% 20 - 05.01.26	1 600 000	EUR	1 544 229	1 519 232	0,04
EssilorLuxottica SA 0.50% 20 - 05.06.28	1 900 000	EUR	1 777 631	1 733 218	0,04
EssilorLuxottica SA 0.75% 19 - 27.11.31	1 600 000	EUR	1 362 092	1 379 920	0,04
Firmenich Productions Participations SAS 1.375% 20 - 30.10.26	1 122 000	EUR	1 089 150	1 076 570	0,03
Firmenich Productions Participations SAS 1.75% 20 - 30.04.30	1 398 000	EUR	1 296 375	1 294 674	0,03
Gecina SA 0.875% 21 - 30.06.36	800 000	EUR	625 919	591 336	0,02
Gecina SA 0.875% 22 - 25.01.33	900 000	EUR	743 829	743 112	0,02
Gecina SA 1.00% 16 - 30.01.29	700 000	EUR	634 648	637 224	0,02
Gecina SA 1.375% 17 - 30.06.27	800 000	EUR	761 126	761 760	0,02
Gecina SA 1.375% 17 - 26.01.28	1 500 000	EUR	1 414 153	1 406 130	0,04
Gecina SA 1.50% 15 - 20.01.25	600 000	EUR	594 391	588 312	0,02
Gecina SA 1.625% 18 - 14.03.30	800 000	EUR	720 598	741 064	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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% 19 - 29.05.34	1 300 000	EUR	1 141 268	1 129 622	0,03
Gecina SA 2.00% 17 - 30.06.32	900 000	EUR	804 329	830 160	0,02
Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR FRN 21 - 21.04.42	1 100 000	EUR	903 411	887 722	0,02
Groupe VYV 1.625% 19 - 02.07.29	800 000	EUR	705 881	723 680	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 0.625% 21 - 14.09.28	900 000	EUR	814 047	794 907	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.475% 22 - 18.01.31	1 500 000	EUR	1 330 041	1 285 845	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.625% 17 - 27.11.27	900 000	EUR	832 926	843 678	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.625% 20 - 18.09.29	1 100 000	EUR	963 415	988 988	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 2.25% 14 - 24.03.25	1 000 000	EUR	993 238	980 300	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 2.50% 20 - 04.05.27	900 000	EUR	869 471	873 621	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 4.25% 23 - 18.03.30	500 000	EUR	493 743	514 000	0,01
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0.125% 21 - 16.09.25	600 000	EUR	559 791	563 706	0,01
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0.625% 21 - 16.09.28	658 000	EUR	556 284	571 572	0,01
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 4.50% 23 - 06.04.27	400 000	EUR	398 853	408 864	0,01
HSBC Continental Europe SA 0.10% 19 - 03.09.27	2 100 000	EUR	1 929 792	1 884 288	0,05
HSBC Continental Europe SA 1.375% 18 - 04.09.28	1 200 000	EUR	1 117 816	1 106 316	0,03
ICADE 0.625% 21 - 18.01.31	900 000	EUR	717 736	709 380	0,02
ICADE 1.00% 22 - 19.01.30	900 000	EUR	780 470	765 549	0,02
ICADE 1.125% 16 - 17.11.25	900 000	EUR	865 454	856 746	0,02
ICADE 1.50% 17 - 13.09.27	800 000	EUR	764 050	744 256	0,02
ICADE 1.625% 18 - 28.02.28	900 000	EUR	849 234	836 883	0,02
ICADE 1.75% 16 - 10.06.26	900 000	EUR	871 487	859 140	0,02
Imerys SA 1.00% 21 - 15.07.31	400 000	EUR	305 529	314 972	0,01
Imerys SA 1.50% 17 - 15.01.27	1 000 000	EUR	947 117	937 480	0,02
Imerys SA 1.875% 16 - 31.03.28	300 000	EUR	286 765	277 401	0,01
Imerys SA 4.75% 23 - 29.11.29	900 000	EUR	898 967	915 264	0,02
Indigo Group SAS 1.625% 18 - 19.04.28	1 000 000	EUR	940 970	930 190	0,02
Indigo Group SAS 2.125% 14 - 16.04.25	400 000	EUR	396 295	391 072	0,01
Indigo Group SAS 4.50% 23 - 18.04.30	1 100 000	EUR	1 087 326	1 143 747	0,03
In'li SA 1.125% 19 - 02.07.29	800 000	EUR	685 398	707 104	0,02
JCDecaux SE 1.625% 22 - 07.02.30	700 000	EUR	604 460	610 064	0,02
JCDecaux SE 2.625% 20 - 24.04.28	700 000	EUR	675 580	685 671	0,02
JCDecaux SE 5.00% 23 - 11.01.29	1 000 000	EUR	1 007 868	1 051 230	0,03
Kering SA 0.75% 20 - 13.05.28	700 000	EUR	635 387	641 515	0,02
Kering SA 1.25% 16 - 10.05.26	800 000	EUR	767 402	768 888	0,02
Kering SA 1.25% 22 - 05.05.25	1 000 000	EUR	974 772	971 790	0,03
Kering SA 1.50% 17 - 05.04.27	600 000	EUR	565 358	574 440	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Kering SA 1.875% 22 - 05.05.30	1 100 000	EUR	1 014 907	1 037 476	0,03
Kering SA 3.25% 23 - 27.02.29	1 200 000	EUR	1 184 475	1 220 484	0,03
Kering SA 3.375% 23 - 27.02.33	1 000 000	EUR	976 091	1 018 670	0,03
Kering SA 3.625% 23 - 05.09.27	1 000 000	EUR	1 000 997	1 022 680	0,03
Kering SA 3.625% 23 - 05.09.31	1 600 000	EUR	1 592 639	1 654 624	0,04
Kering SA 3.75% 23 - 05.09.25	1 200 000	EUR	1 199 841	1 209 144	0,03
Kering SA 3.875% 23 - 05.09.35	2 000 000	EUR	1 984 868	2 096 740	0,05
Klepierre SA 0.625% 19 - 01.07.30	1 100 000	EUR	960 844	916 696	0,02
Klepierre SA 0.875% 20 - 17.02.31	1 000 000	EUR	810 463	831 840	0,02
Klepierre SA 1.25% 16 - 29.09.31	700 000	EUR	616 532	591 682	0,02
Klepierre SA 1.375% 17 - 16.02.27	1 100 000	EUR	1 043 264	1 042 448	0,03
Klepierre SA 1.625% 17 - 13.12.32	1 000 000	EUR	876 966	855 610	0,02
Klepierre SA 1.875% 16 - 19.02.26	600 000	EUR	582 667	583 782	0,02
Klepierre SA 2.00% 20 - 12.05.29	1 300 000	EUR	1 221 405	1 219 621	0,03
La Mondiale SAM 0.75% 20 - 20.04.26	700 000	EUR	657 257	656 166	0,02
La Mondiale SAM 2.125% 20 - 23.06.31	800 000	EUR	685 852	690 480	0,02
La Mondiale SAM FRN 14 - 29.12.49	1 103 000	EUR	1 123 542	1 102 349	0,03
Legrand SA 0.375% 21 - 06.10.31	800 000	EUR	700 602	668 552	0,02
Legrand SA 0.625% 19 - 24.06.28	700 000	EUR	655 129	639 772	0,02
Legrand SA 0.75% 20 - 20.05.30	1 200 000	EUR	1 047 875	1 051 668	0,03
Legrand SA 1.00% 18 - 06.03.26	200 000	EUR	191 774	192 454	0,00
Legrand SA 1.875% 15 - 16.12.27	200 000	EUR	190 321	191 936	0,00
Legrand SA 1.875% 17 - 06.07.32	600 000	EUR	546 466	561 192	0,01
Legrand SA 3.50% 23 - 29.05.29	1 300 000	EUR	1 309 002	1 343 212	0,03
L'Oreal SA 0.875% 22 - 29.06.26	1 800 000	EUR	1 737 320	1 716 228	0,04
L'Oreal SA 2.875% 23 - 19.05.28	1 600 000	EUR	1 579 496	1 608 096	0,04
L'Oreal SA 3.125% 23 - 19.05.25	1 600 000	EUR	1 592 983	1 597 552	0,04
L'Oreal SA 3.375% 23 - 23.01.27	1 200 000	EUR	1 203 840	1 219 632	0,03
L'Oreal SA 3.375% 23 - 23.11.29	1 000 000	EUR	1 003 146	1 030 960	0,03
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE Zero Coupon 20 - 11.02.26	1 700 000	EUR	1 627 039	1 602 573	0,04
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 0.125% 20 - 11.02.28	2 400 000	EUR	2 233 026	2 169 840	0,06
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 0.375% 20 - 11.02.31	2 000 000	EUR	1 786 093	1 706 960	0,04
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 0.75% 20 - 07.04.25	2 000 000	EUR	1 972 130	1 939 540	0,05
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 3.25% 23 - 07.09.29	1 700 000	EUR	1 680 177	1 731 297	0,04
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 3.375% 23 - 21.10.25	1 800 000	EUR	1 801 141	1 811 790	0,05
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 3.50% 23 - 07.09.33	2 300 000	EUR	2 247 747	2 375 463	0,06
Mercialys SA 1.80% 18 - 27.02.26	400 000	EUR	374 316	382 236	0,01
Mercialys SA 2.50% 22 - 28.02.29	700 000	EUR	627 878	638 967	0,02
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal 0.625% 21 - 21.06.27	600 000	EUR	540 650	543 774	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN 21 - 21.06.52	1 400 000	EUR	1 080 034	1 077 062	0,03
Nerval SAS 2.875% 22 - 14.04.32	700 000	EUR	609 764	630 203	0,02
Nerval SAS 3.625% 22 - 20.07.28	500 000	EUR	486 634	496 975	0,01
New Immo Holdings SA 2.75% 19 - 26.11.26	400 000	EUR	372 257	367 920	0,01
Orange SA Zero Coupon 19 - 04.09.26	1 000 000	EUR	943 966	927 010	0,02
Orange SA Zero Coupon 21 - 29.06.26	1 400 000	EUR	1 308 222	1 303 610	0,03
Orange SA 0.125% 20 - 16.09.29	1 000 000	EUR	855 361	863 460	0,02
Orange SA 0.50% 19 - 04.09.32	1 600 000	EUR	1 360 457	1 305 440	0,03
Orange SA 0.625% 21 - 16.12.33	1 400 000	EUR	1 175 877	1 120 294	0,03
Orange SA 0.75% 21 - 29.06.34	1 200 000	EUR	935 370	955 500	0,02
Orange SA 0.875% 16 - 03.02.27	1 000 000	EUR	977 406	942 140	0,02
Orange SA 1.00% 16 - 12.05.25	1 200 000	EUR	1 173 638	1 161 876	0,03
Orange SA 1.00% 18 - 12.09.25	1 000 000	EUR	977 709	963 900	0,02
Orange SA 1.20% 19 - 11.07.34	500 000	EUR	430 828	415 780	0,01
Orange SA 1.25% 20 - 07.07.27	1 100 000	EUR	1 046 849	1 042 217	0,03
Orange SA 1.375% 18 - 16.01.30	1 500 000	EUR	1 389 955	1 378 650	0,04
Orange SA 1.375% 18 - 20.03.28	1 400 000	EUR	1 344 602	1 319 864	0,03
Orange SA 1.375% 19 - 04.09.49	1 100 000	EUR	752 704	798 567	0,02
Orange SA FRN 21 - 31.12.99	700 000	EUR	584 123	596 785	0,02
Orange SA 1.50% 17 - 09.09.27	700 000	EUR	672 949	671 384	0,02
Orange SA 1.625% 20 - 07.04.32	1 000 000	EUR	948 213	904 880	0,02
Orange SA FRN 19 - 31.12.99	800 000	EUR	730 431	743 800	0,02
Orange SA FRN 20 - 31.12.99	1 000 000	EUR	874 424	886 770	0,02
Orange SA 1.875% 18 - 12.09.30	1 800 000	EUR	1 710 753	1 689 552	0,04
Orange SA 2.00% 19 - 15.01.29	2 000 000	EUR	1 952 654	1 921 480	0,05
Orange SA FRN 19 - 31.12.99	1 300 000	EUR	1 260 540	1 264 068	0,03
Orange SA 2.375% 22 - 18.05.32	800 000	EUR	763 925	766 968	0,02
Orange SA 3.625% 22 - 16.11.31	1 300 000	EUR	1 295 026	1 356 511	0,04
Orange SA 3.875% 23 - 11.09.35	700 000	EUR	681 470	744 821	0,02
Orange SA FRN 14 - 29.10.49	1 732 000	EUR	1 806 412	1 767 887	0,05
Orange SA FRN 23 - 31.12.99	1 600 000	EUR	1 584 010	1 675 792	0,04
Orange SA 8.125% 03 - 28.01.33	2 200 000	EUR	3 164 284	3 084 620	0,08
Pernod Ricard SA 0.125% 21 - 04.10.29	500 000	EUR	428 052	426 835	0,01
Pernod Ricard SA 0.50% 19 - 24.10.27	600 000	EUR	552 354	551 838	0,01
Pernod Ricard SA 0.875% 19 - 24.10.31	700 000	EUR	585 022	597 828	0,02
Pernod Ricard SA 1.125% 20 - 07.04.25	1 600 000	EUR	1 572 397	1 554 832	0,04
Pernod Ricard SA 1.375% 22 - 07.04.29	1 100 000	EUR	1 015 944	1 018 633	0,03
Pernod Ricard SA 1.50% 16 - 18.05.26	700 000	EUR	676 943	679 476	0,02
Pernod Ricard SA 1.75% 20 - 08.04.30	1 700 000	EUR	1 632 419	1 577 464	0,04
Pernod Ricard SA 3.25% 22 - 02.11.28	700 000	EUR	694 795	710 605	0,02
Pernod Ricard SA 3.75% 22 - 02.11.32	800 000	EUR	797 536	837 912	0,02
Pernod Ricard SA 3.75% 23 - 15.09.27	1 200 000	EUR	1 196 675	1 230 756	0,03
Pernod Ricard SA 3.75% 23 - 15.09.33	1 100 000	EUR	1 071 325	1 146 002	0,03
Praemia Healthcare SACA 0.875% 19 - 04.11.29	800 000	EUR	650 603	662 256	0,02
Praemia Healthcare SACA 1.375% 20 - 17.09.30	900 000	EUR	750 262	742 761	0,02
Praemia Healthcare SACA 5.50% 23 - 19.09.28	800 000	EUR	795 783	838 064	0,02
PSA Tresorerie GIE 6.00% 03 - 19.09.33	970 000	EUR	1 102 266	1 146 288	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
RCI Banque SA 0.50% 22 - 14.07.25	1 293 000	EUR	1 247 014	1 235 255	0,03
RCI Banque SA 1.125% 20 - 15.01.27	900 000	EUR	835 374	842 256	0,02
RCI Banque SA 1.625% 17 - 11.04.25	859 000	EUR	841 256	838 444	0,02
RCI Banque SA 1.625% 18 - 26.05.26	1 200 000	EUR	1 138 242	1 147 812	0,03
RCI Banque SA 1.75% 19 - 10.04.26	800 000	EUR	778 199	768 368	0,02
RCI Banque SA 4.125% 22 - 01.12.25	1 307 000	EUR	1 304 640	1 316 437	0,03
RCI Banque SA 4.50% 23 - 06.04.27	1 200 000	EUR	1 195 911	1 232 748	0,03
RCI Banque SA 4.625% 23 - 13.07.26	1 053 000	EUR	1 058 339	1 076 440	0,03
RCI Banque SA 4.625% 23 - 02.10.26	1 260 000	EUR	1 263 113	1 292 785	0,03
RCI Banque SA 4.75% 22 - 06.07.27	500 000	EUR	504 836	521 840	0,01
RCI Banque SA 4.875% 22 - 21.09.28	860 000	EUR	857 251	909 906	0,02
RCI Banque SA 4.875% 23 - 14.06.28	1 230 000	EUR	1 226 360	1 294 390	0,03
RCI Banque SA 4.875% 23 - 02.10.29	1 290 000	EUR	1 280 333	1 356 577	0,04
Safran SA 0.125% 21 - 16.03.26	1 200 000	EUR	1 136 320	1 123 848	0,03
Safran SA 0.75% 21 - 17.03.31	1 000 000	EUR	852 757	870 610	0,02
SANEF SA 0.95% 16 - 19.10.28	200 000	EUR	175 314	180 424	0,00
SANEF SA 1.875% 15 - 16.03.26	900 000	EUR	873 697	871 695	0,02
Sanofi 0.50% 16 - 13.01.27	1 600 000	EUR	1 543 434	1 501 424	0,04
Sanofi 0.875% 19 - 21.03.29	1 100 000	EUR	1 011 361	1 005 686	0,03
Sanofi 0.875% 22 - 06.04.25	1 100 000	EUR	1 072 505	1 067 308	0,03
Sanofi 1.00% 18 - 21.03.26	2 200 000	EUR	2 158 729	2 113 650	0,05
Sanofi 1.00% 20 - 01.04.25	1 400 000	EUR	1 377 835	1 359 932	0,04
Sanofi 1.125% 16 - 05.04.28	1 000 000	EUR	967 895	939 410	0,02
Sanofi 1.25% 19 - 21.03.34	800 000	EUR	683 015	695 800	0,02
Sanofi 1.25% 22 - 06.04.29	1 100 000	EUR	1 013 118	1 023 748	0,03
Sanofi 1.375% 18 - 21.03.30	2 800 000	EUR	2 689 082	2 585 800	0,07
Sanofi 1.50% 15 - 22.09.25	1 100 000	EUR	1 084 765	1 071 884	0,03
Sanofi 1.50% 20 - 01.04.30	1 500 000	EUR	1 417 502	1 394 235	0,04
Sanofi 1.75% 14 - 10.09.26	2 400 000	EUR	2 366 751	2 336 112	0,06
Sanofi 1.875% 18 - 21.03.38	2 000 000	EUR	1 750 399	1 763 520	0,05
Schlumberger Finance France SAS 1.00% 18 - 18.02.26	739 000	EUR	706 557	707 186	0,02
Schneider Electric SE 0.25% 20 - 11.03.29	1 000 000	EUR	913 303	881 890	0,02
Schneider Electric SE 0.875% 15 - 11.03.25	1 000 000	EUR	988 335	974 050	0,03
Schneider Electric SE 0.875% 17 - 13.12.26	1 200 000	EUR	1 141 041	1 142 040	0,03
Schneider Electric SE 1.00% 20 - 09.04.27	900 000	EUR	863 737	852 381	0,02
Schneider Electric SE 1.375% 18 - 21.06.27	1 200 000	EUR	1 166 100	1 144 536	0,03
Schneider Electric SE 1.50% 19 - 15.01.28	1 200 000	EUR	1 164 143	1 143 636	0,03
Schneider Electric SE 3.125% 23 - 13.10.29	800 000	EUR	792 895	814 696	0,02
Schneider Electric SE 3.25% 22 - 09.11.27	800 000	EUR	801 147	812 320	0,02
Schneider Electric SE 3.25% 23 - 12.06.28	800 000	EUR	790 808	816 760	0,02
Schneider Electric SE 3.375% 23 - 13.04.34	900 000	EUR	881 555	926 379	0,02
Schneider Electric SE 3.375% 23 - 06.04.25	1 100 000	EUR	1 098 567	1 100 781	0,03
Schneider Electric SE 3.50% 22 - 09.11.32	1 000 000	EUR	1 009 388	1 043 220	0,03
Schneider Electric SE 3.50% 23 - 12.06.33	600 000	EUR	592 797	623 358	0,02
SCOR SE FRN 20 - 17.09.51	400 000	EUR	314 978	316 460	0,01
SCOR SE FRN 15 - 08.06.46	900 000	EUR	860 187	874 485	0,02
SCOR SE FRN 16 - 27.05.48	700 000	EUR	687 397	689 157	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Fonciere Lyonnaise SA 0.50% 21 - 21.04.28	600 000	EUR	537 807	538 284	0,01
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 18 - 29.05.25	1 000 000	EUR	971 764	972 810	0,03
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 20 - 05.06.27	700 000	EUR	669 832	670 432	0,02
Societe Generale SA 0.125% 20 - 24.02.26	2 000 000	EUR	1 875 392	1 873 200	0,05
Societe Generale SA 0.125% 21 - 18.02.28	1 300 000	EUR	1 201 497	1 148 212	0,03
Societe Generale SA FRN 21 - 17.11.26	1 600 000	EUR	1 505 277	1 501 968	0,04
Societe Generale SA 0.25% 21 - 08.07.27	1 400 000	EUR	1 288 070	1 260 392	0,03
Societe Generale SA FRN 21 - 12.06.29	1 500 000	EUR	1 340 424	1 300 815	0,03
Societe Generale SA FRN 21 - 02.12.27	1 500 000	EUR	1 377 929	1 375 125	0,04
Societe Generale SA 0.75% 20 - 25.01.27	2 100 000	EUR	1 955 274	1 931 454	0,05
Societe Generale SA 0.875% 19 - 01.07.26	1 000 000	EUR	947 909	939 620	0,02
Societe Generale SA 0.875% 19 - 24.09.29	1 000 000	EUR	890 634	855 410	0,02
Societe Generale SA FRN 20 - 22.09.28	1 300 000	EUR	1 206 996	1 179 854	0,03
Societe Generale SA FRN 20 - 24.11.30	1 600 000	EUR	1 479 432	1 500 736	0,04
Societe Generale SA 1.125% 18 - 23.01.25	1 900 000	EUR	1 861 879	1 846 534	0,05
Societe Generale SA FRN 20 - 21.04.26	1 100 000	EUR	1 069 297	1 061 731	0,03
Societe Generale SA FRN 21 - 30.06.31	1 500 000	EUR	1 367 864	1 379 115	0,04
Societe Generale SA 1.25% 20 - 12.06.30	1 600 000	EUR	1 340 449	1 376 064	0,04
Societe Generale SA 1.375% 17 - 13.01.28	1 300 000	EUR	1 182 010	1 205 724	0,03
Societe Generale SA 1.75% 19 - 22.03.29	2 000 000	EUR	1 840 804	1 817 540	0,05
Societe Generale SA 2.125% 18 - 27.09.28	1 700 000	EUR	1 652 555	1 606 058	0,04
Societe Generale SA 2.625% 15 - 27.02.25	1 800 000	EUR	1 779 391	1 773 558	0,05
Societe Generale SA 2.625% 22 - 30.05.29	1 600 000	EUR	1 527 742	1 555 920	0,04
Societe Generale SA 4.00% 22 - 16.11.27	1 600 000	EUR	1 604 625	1 638 112	0,04
Societe Generale SA 4.125% 23 - 02.06.27	1 900 000	EUR	1 898 385	1 949 096	0,05
Societe Generale SA 4.125% 23 - 21.11.28	1 600 000	EUR	1 619 384	1 657 136	0,04
Societe Generale SA 4.25% 22 - 16.11.32	1 800 000	EUR	1 819 493	1 913 886	0,05
Societe Generale SA FRN 22 - 06.12.30	2 300 000	EUR	2 228 369	2 337 835	0,06
Societe Generale SA 4.25% 23 - 28.09.26	2 400 000	EUR	2 401 500	2 460 168	0,06
Societe Generale SA FRN 23 - 28.09.29	1 400 000	EUR	1 392 005	1 458 912	0,04
Societe Generale SA FRN 23 - 21.11.31	1 900 000	EUR	1 914 441	1 987 058	0,05
Societe Generale SA FRN 22 - 06.09.32	900 000	EUR	887 665	934 119	0,02
Societe Generale SA 5.625% 23 - 02.06.33	1 400 000	EUR	1 383 431	1 492 666	0,04
Sodexo SA 0.75% 16 - 14.04.27	850 000	EUR	809 037	806 149	0,02
Sodexo SA 0.75% 20 - 27.04.25	1 028 000	EUR	1 004 816	993 326	0,03
Sodexo SA 1.00% 20 - 27.04.29	1 305 000	EUR	1 201 002	1 185 462	0,03
Sodexo SA 1.00% 20 - 17.07.28	873 000	EUR	817 085	802 479	0,02
Sodexo SA 2.50% 14 - 24.06.26	792 000	EUR	775 226	779 740	0,02
Sogecap SA FRN 14 - 29.12.49	1 200 000	EUR	1 184 331	1 182 648	0,03
Sogecap SA FRN 23 - 16.05.44	1 200 000	EUR	1 231 239	1 295 388	0,03
Suez SACA 1.875% 22 - 24.05.27	1 100 000	EUR	1 038 645	1 052 260	0,03
Suez SACA 2.375% 22 - 24.05.30	1 300 000	EUR	1 211 913	1 224 691	0,03
Suez SACA 2.875% 22 - 24.05.34	1 600 000	EUR	1 458 707	1 491 568	0,04
Suez SACA 4.50% 23 - 13.11.33	800 000	EUR	821 562	853 440	0,02
Suez SACA 4.625% 22 - 03.11.28	1 100 000	EUR	1 117 747	1 165 296	0,03
Suez SACA 5.00% 22 - 03.11.32	1 300 000	EUR	1 341 519	1 437 085	0,04
TDF Infrastructure SASU 1.75% 21 - 01.12.29	1 100 000	EUR	919 006	960 553	0,02
TDF Infrastructure SASU 2.50% 16 - 07.04.26	900 000	EUR	871 338	877 743	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
TDF Infrastructure SASU 5.625% 23 - 21.07.28	1 000 000	EUR	1 000 121	1 051 340	0,03
Teleperformance 0.25% 20 - 26.11.27	700 000	EUR	603 840	624 757	0,02
Teleperformance 1.875% 18 - 02.07.25	800 000	EUR	784 772	775 216	0,02
Teleperformance 3.75% 22 - 24.06.29	600 000	EUR	575 849	597 942	0,02
Teleperformance SE 5.25% 23 - 22.11.28	1 200 000	EUR	1 217 610	1 256 436	0,03
Teleperformance SE 5.75% 23 - 22.11.31	1 100 000	EUR	1 115 062	1 168 607	0,03
Terega SA 0.875% 20 - 17.09.30	700 000	EUR	594 083	592 032	0,02
Terega SA 2.20% 15 - 05.08.25	1 100 000	EUR	1 075 711	1 080 959	0,03
Terega SASU 0.625% 20 - 27.02.28	400 000	EUR	362 898	356 660	0,01
Thales SA Zero Coupon 20 - 26.03.26	600 000	EUR	567 449	559 368	0,01
Thales SA 0.25% 20 - 29.01.27	600 000	EUR	556 560	552 756	0,01
Thales SA 0.75% 18 - 23.01.25	800 000	EUR	778 620	777 272	0,02
Thales SA 1.00% 20 - 15.05.28	1 000 000	EUR	923 512	916 450	0,02
Thales SA 3.625% 23 - 14.06.29	700 000	EUR	695 186	715 519	0,02
Thales SA 4.00% 23 - 18.10.25	1 200 000	EUR	1 198 394	1 215 960	0,03
Thales SA 4.125% 23 - 18.10.28	1 000 000	EUR	1 001 843	1 045 190	0,03
Thales SA 4.25% 23 - 18.10.31	1 000 000	EUR	996 661	1 061 960	0,03
Tikehau Capital SCA 1.625% 21 - 31.03.29	700 000	EUR	587 971	605 094	0,02
Tikehau Capital SCA 2.25% 19 - 14.10.26	700 000	EUR	662 775	673 554	0,02
Tikehau Capital SCA 6.625% 23 - 14.03.30	500 000	EUR	501 224	545 765	0,01
TotalEnergies Capital International SA 0.696% 19 - 31.05.28	1 100 000	EUR	992 911	1 002 001	0,03
TotalEnergies Capital International SA 0.75% 16 - 12.07.28	2 300 000	EUR	2 147 346	2 101 556	0,05
TotalEnergies Capital International SA 0.952% 20 - 18.05.31	900 000	EUR	770 124	782 802	0,02
TotalEnergies Capital International SA 1.023% 18 - 04.03.27	1 100 000	EUR	1 066 025	1 040 072	0,03
TotalEnergies Capital International SA 1.375% 14 - 19.03.25	1 300 000	EUR	1 284 040	1 266 057	0,03
TotalEnergies Capital International SA 1.375% 17 - 04.10.29	1 600 000	EUR	1 502 879	1 470 784	0,04
TotalEnergies Capital International SA 1.491% 18 - 04.09.30	1 300 000	EUR	1 180 476	1 186 588	0,03
TotalEnergies Capital International SA 1.491% 20 - 08.04.27	2 400 000	EUR	2 306 740	2 294 304	0,06
TotalEnergies Capital International SA 1.535% 19 - 31.05.39	900 000	EUR	708 690	713 736	0,02
TotalEnergies Capital International SA 1.618% 20 - 18.05.40	1 400 000	EUR	1 113 312	1 097 614	0,03
TotalEnergies Capital International SA 1.994% 20 - 08.04.32	2 100 000	EUR	2 020 944	1 944 054	0,05
TotalEnergies Capital International SA 2.50% 14 - 25.03.26	1 400 000	EUR	1 403 654	1 383 592	0,04
TotalEnergies Capital International SA 2.875% 13 - 19.11.25	1 200 000	EUR	1 195 606	1 194 456	0,03
TotalEnergies SE FRN 21 - 31.12.99	2 225 000	EUR	1 955 461	1 991 508	0,05
TotalEnergies SE FRN 20 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 220 153	1 265 730	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
TotalEnergies SE FRN 22 - 31.12.99	1 357 000	EUR	1 247 369	1 251 778	0,03
TotalEnergies SE FRN 21 - 31.12.99	2 390 000	EUR	1 876 271	1 913 028	0,05
TotalEnergies SE FRN 15 - 29.12.49	46 000	EUR	47 299	44 954	0,00
TotalEnergies SE FRN 15 - 29.12.49	3 619 000	EUR	3 574 642	3 536 668	0,09
TotalEnergies SE FRN 22 - 31.12.99	1 100 000	EUR	860 345	908 369	0,02
TotalEnergies SE FRN 16 - 29.12.49	2 225 000	EUR	2 214 535	2 167 461	0,06
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.625% 20 - 04.05.27	1 400 000	EUR	1 290 981	1 280 258	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.75% 21 - 25.10.28	1 000 000	EUR	884 467	896 810	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.875% 16 - 21.02.25	600 000	EUR	580 865	580 782	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.875% 19 - 29.03.32	1 100 000	EUR	889 722	879 549	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 15 - 14.03.25	699 000	EUR	682 538	676 695	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 19 - 27.02.27	1 100 000	EUR	1 026 029	1 027 037	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.125% 16 - 28.04.27	572 000	EUR	533 863	540 637	0,01
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.125% 18 - 15.09.25	1 500 000	EUR	1 443 605	1 445 415	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 15 - 15.04.30	1 300 000	EUR	1 156 423	1 145 131	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 16 - 09.03.26	653 000	EUR	623 426	626 501	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 20 - 04.12.31	1 600 000	EUR	1 331 970	1 353 088	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 21 - 25.05.33	900 000	EUR	743 237	740 160	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.50% 17 - 22.02.28	971 000	EUR	920 844	908 885	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.50% 17 - 29.05.29	622 000	EUR	541 667	564 938	0,01
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.75% 19 - 27.02.34	1 200 000	EUR	1 051 542	1 020 276	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.75% 19 - 01.07.49	800 000	EUR	539 844	521 040	0,01
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.875% 18 - 15.01.31	1 300 000	EUR	1 153 016	1 167 504	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.00% 16 - 28.04.36	750 000	EUR	631 439	625 500	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.00% 17 - 29.05.37	799 000	EUR	647 636	654 349	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.00% 20 - 29.06.32	1 100 000	EUR	949 386	974 391	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.125% 20 - 09.04.25	1 000 000	EUR	985 517	980 600	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.25% 18 - 14.05.38	700 000	EUR	567 846	574 616	0,01
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.50% 14 - 04.06.26	960 000	EUR	943 655	945 552	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.625% 20 - 09.04.30	900 000	EUR	876 870	872 469	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN 18 - 31.12.99	1 100 000	EUR	980 357	965 921	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 4.125% 23 - 11.12.30	1 100 000	EUR	1 141 866	1 135 057	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN 23 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 360 592	1 497 870	0,04
Veolia Environnement SA Zero Coupon 21 - 14.01.27	1 100 000	EUR	1 014 477	1 005 477	0,03
Veolia Environnement SA Zero Coupon 21 - 09.06.26	1 400 000	EUR	1 303 200	1 301 398	0,03
Veolia Environnement SA 0.50% 19 - 14.10.31	800 000	EUR	718 684	662 272	0,02
Veolia Environnement SA 0.664% 20 - 15.01.31	700 000	EUR	607 829	592 676	0,02
Veolia Environnement SA 0.80% 20 - 15.01.32	1 000 000	EUR	829 739	834 420	0,02
Veolia Environnement SA 0.927% 16 - 04.01.29	700 000	EUR	639 255	634 256	0,02
Veolia Environnement SA 1.00% 17 - 03.04.25	600 000	EUR	585 379	582 648	0,02
Veolia Environnement SA 1.25% 16 - 19.05.28	1 200 000	EUR	1 149 993	1 116 732	0,03
Veolia Environnement SA 1.25% 20 - 02.04.27	1 100 000	EUR	1 061 279	1 042 679	0,03
Veolia Environnement SA 1.25% 20 - 15.04.28	800 000	EUR	773 023	748 784	0,02
Veolia Environnement SA 1.25% 20 - 14.05.35	1 100 000	EUR	894 131	895 906	0,02
Veolia Environnement SA 1.496% 17 - 30.11.26	800 000	EUR	784 210	770 376	0,02
Veolia Environnement SA 1.50% 17 - 03.04.29	1 300 000	EUR	1 239 423	1 204 749	0,03
Veolia Environnement SA 1.59% 15 - 10.01.28	800 000	EUR	756 726	754 632	0,02
Veolia Environnement SA 1.625% 17 - 21.09.32	800 000	EUR	726 685	709 064	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.625% 18 - 17.09.30	1 100 000	EUR	1 011 450	1 003 299	0,03
Veolia Environnement SA 1.75% 15 - 10.09.25	1 000 000	EUR	978 682	975 500	0,03
Veolia Environnement SA 1.94% 18 - 07.01.30	1 000 000	EUR	965 675	935 260	0,02
Veolia Environnement SA 4.625% 12 - 30.03.27	1 100 000	EUR	1 177 073	1 155 869	0,03
Veolia Environnement SA 6.125% 03 - 25.11.33	1 049 000	EUR	1 334 492	1 304 211	0,03
Verallia SA 1.625% 21 - 14.05.28	700 000	EUR	627 146	653 373	0,02
Verallia SA 1.875% 21 - 10.11.31	800 000	EUR	664 716	702 088	0,02
Vinci SA Zero Coupon 20 - 27.11.28	800 000	EUR	695 805	702 272	0,02
Vinci SA 0.50% 21 - 09.01.32	1 200 000	EUR	985 360	989 712	0,03
Vinci SA 1.00% 18 - 26.09.25	1 100 000	EUR	1 070 340	1 064 228	0,03
Vinci SA 1.625% 19 - 18.01.29	1 200 000	EUR	1 160 569	1 131 828	0,03
Vinci SA 1.75% 18 - 26.09.30	1 700 000	EUR	1 626 408	1 579 946	0,04
Vinci SA 3.375% 22 - 17.10.32	1 000 000	EUR	984 711	1 017 980	0,03
Vinci SA 3.375% 23 - 04.02.25	800 000	EUR	796 196	800 008	0,02
Vivendi SE 0.625% 19 - 11.06.25	1 100 000	EUR	1 067 704	1 058 013	0,03
Vivendi SE 1.125% 19 - 11.12.28	1 000 000	EUR	929 857	948 020	0,02
Vivendi SE 1.875% 16 - 26.05.26	600 000	EUR	579 155	586 830	0,02
Wendel SE 1.00% 21 - 01.06.31	300 000	EUR	243 778	251 430	0,01
Wendel SE 1.375% 22 - 18.01.34	300 000	EUR	223 426	238 704	0,01
Wendel SE 2.50% 15 - 09.02.27	1 000 000	EUR	962 061	967 840	0,03
Wendel SE 4.50% 23 - 19.06.30	600 000	EUR	592 321	619 746	0,02
Worldline SA 0.875% 20 - 30.06.27	600 000	EUR	549 525	541 764	0,01
Worldline SA 4.125% 23 - 12.09.28	900 000	EUR	885 176	890 370	0,02
WPP Finance SA 2.25% 14 - 22.09.26	800 000	EUR	784 446	783 432	0,02
WPP Finance SA 2.375% 20 - 19.05.27	1 311 000	EUR	1 278 760	1 285 501	0,03
WPP Finance SA 4.125% 23 - 30.05.28	1 360 000	EUR	1 361 217	1 402 826	0,04
			809 264 696	814 289 490	21,07
Allemagne					
Aareal Bank AG 0.05% 21 - 02.09.26	600 000	EUR	552 811	535 986	0,01
Aareal Bank AG 0.25% 20 - 23.11.27	1 000 000	EUR	846 091	854 230	0,02
Aareal Bank AG 0.50% 20 - 07.04.27	800 000	EUR	698 173	707 936	0,02
Aareal Bank AG 0.75% 22 - 18.04.28	800 000	EUR	667 174	690 200	0,02
Aareal Bank AG 4.50% 22 - 25.07.25	700 000	EUR	696 273	701 589	0,02
adidas AG Zero Coupon 20 - 05.10.28	800 000	EUR	706 643	706 136	0,02
adidas AG 0.625% 20 - 10.09.35	900 000	EUR	676 084	693 747	0,02
adidas AG 3.00% 22 - 21.11.25	800 000	EUR	794 038	800 872	0,02
adidas AG 3.125% 22 - 21.11.29	700 000	EUR	691 815	712 404	0,02
Albemarle New Holdings GmbH 1.125% 19 - 25.11.25	600 000	EUR	569 315	574 752	0,01
Albemarle New Holdings GmbH 1.625% 19 - 25.11.28	864 000	EUR	799 623	788 936	0,02
Allianz SE FRN 19 - 25.09.49	1 600 000	EUR	1 367 949	1 380 560	0,04
Allianz SE FRN 20 - 08.07.50	1 400 000	EUR	1 214 008	1 233 652	0,03
Allianz SE FRN 15 - 07.07.45	2 200 000	EUR	2 152 131	2 134 858	0,06
Allianz SE FRN 15 - 07.07.45	300 000	EUR	294 989	291 117	0,01
Allianz SE FRN 17 - 06.07.47	1 500 000	EUR	1 477 198	1 468 995	0,04
Allianz SE FRN 22 - 05.07.52	1 800 000	EUR	1 708 422	1 783 242	0,05
Allianz SE FRN 22 - 07.09.38	2 000 000	EUR	1 951 809	2 049 220	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Allianz SE FRN 23 - 25.07.53	1 800 000	EUR	1 837 791	1 970 442	0,05
alstria office REIT-AG 0.50% 19 - 26.09.25	600 000	EUR	527 393	517 932	0,01
alstria office REIT-AG 1.50% 17 - 15.11.27	500 000	EUR	388 618	373 610	0,01
alstria office REIT-AG 1.50% 20 - 23.06.26	500 000	EUR	432 438	408 345	0,01
Amphenol Technologies Holdings GmbH 0.75% 20 - 04.05.26	615 000	EUR	595 008	583 211	0,02
Amphenol Technologies Holdings GmbH 2.00% 18 - 08.10.28	800 000	EUR	778 739	771 352	0,02
Amprion GmbH 0.625% 21 - 23.09.33	1 200 000	EUR	900 522	929 940	0,02
Amprion GmbH 3.45% 22 - 22.09.27	1 100 000	EUR	1 085 803	1 112 397	0,03
Amprion GmbH 3.875% 23 - 07.09.28	900 000	EUR	900 051	928 224	0,02
Amprion GmbH 3.971% 22 - 22.09.32	1 300 000	EUR	1 290 670	1 354 288	0,04
Amprion GmbH 4.125% 23 - 07.09.34	1 200 000	EUR	1 185 791	1 262 652	0,03
BASF SE 0.25% 20 - 05.06.27	1 800 000	EUR	1 665 836	1 648 566	0,04
BASF SE 0.75% 22 - 17.03.26	1 800 000	EUR	1 718 385	1 710 162	0,04
BASF SE 0.875% 16 - 06.10.31	500 000	EUR	433 637	431 395	0,01
BASF SE 0.875% 17 - 15.11.27	1 700 000	EUR	1 605 539	1 574 608	0,04
BASF SE 0.875% 18 - 22.05.25	1 000 000	EUR	984 233	970 120	0,03
BASF SE 1.45% 17 - 13.12.32	100 000	EUR	82 987	86 073	0,00
BASF SE 1.50% 18 - 22.05.30	827 000	EUR	780 349	760 741	0,02
BASF SE 1.50% 22 - 17.03.31	1 600 000	EUR	1 466 584	1 441 200	0,04
BASF SE 1.625% 17 - 15.11.37	1 075 000	EUR	870 391	890 842	0,02
BASF SE 3.125% 22 - 29.06.28	1 000 000	EUR	986 265	1 011 930	0,03
BASF SE 3.75% 22 - 29.06.32	1 000 000	EUR	987 863	1 035 620	0,03
BASF SE 4.00% 23 - 08.03.29	800 000	EUR	813 684	835 584	0,02
BASF SE 4.25% 23 - 08.03.32	900 000	EUR	917 798	958 698	0,02
BASF SE 4.50% 23 - 08.03.35	900 000	EUR	924 210	978 192	0,03
Bayer AG 0.05% 21 - 12.01.25	1 700 000	EUR	1 650 084	1 635 128	0,04
Bayer AG 0.375% 21 - 12.01.29	1 500 000	EUR	1 319 265	1 286 220	0,03
Bayer AG 0.625% 21 - 12.07.31	1 300 000	EUR	1 128 267	1 026 922	0,03
Bayer AG 0.75% 20 - 06.01.27	2 000 000	EUR	1 914 199	1 857 080	0,05
Bayer AG 1.00% 21 - 12.01.36	1 200 000	EUR	918 860	844 452	0,02
Bayer AG 1.125% 20 - 06.01.30	2 200 000	EUR	1 952 358	1 893 958	0,05
Bayer AG 1.375% 20 - 06.07.32	2 400 000	EUR	2 037 431	1 957 248	0,05
Bayer AG 4.00% 23 - 26.08.26	1 300 000	EUR	1 308 926	1 317 745	0,03
Bayer AG 4.25% 23 - 26.08.29	1 200 000	EUR	1 215 359	1 242 948	0,03
Bayer AG 4.625% 23 - 26.05.33	2 200 000	EUR	2 223 879	2 295 524	0,06
Berlin Hyp AG 0.375% 21 - 21.04.31	800 000	EUR	641 698	631 304	0,02
Berlin Hyp AG 0.375% 22 - 25.01.27	900 000	EUR	830 134	829 422	0,02
Berlin Hyp AG 0.50% 19 - 05.11.29	600 000	EUR	503 362	510 216	0,01
Berlin Hyp AG 1.00% 19 - 05.02.26	500 000	EUR	484 581	474 185	0,01
Berlin Hyp AG 1.125% 17 - 25.10.27	1 100 000	EUR	1 019 063	1 006 973	0,03
Berlin Hyp AG 1.25% 15 - 22.01.25	1 100 000	EUR	1 084 823	1 064 767	0,03
Berlin Hyp AG 1.50% 18 - 18.04.28	400 000	EUR	356 463	366 188	0,01
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.125% 16 - 27.04.26	800 000	EUR	761 885	768 152	0,02
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.25% 18 - 29.09.25	900 000	EUR	866 771	871 524	0,02
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.50% 20 - 15.05.30	1 200 000	EUR	1 086 129	1 082 472	0,03
Bertelsmann SE & Co. KGaA 2.00% 20 - 01.04.28	1 000 000	EUR	955 322	959 560	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.50% 22 - 29.05.29	1 100 000	EUR	1 088 313	1 114 509	0,03
Clearstream Banking AG Zero Coupon 20 - 01.12.25	700 000	EUR	661 466	662 592	0,02
Commerzbank AG 0.10% 21 - 11.09.25	1 200 000	EUR	1 140 251	1 137 324	0,03
Commerzbank AG 0.375% 20 - 01.09.27	1 106 000	EUR	1 018 962	1 011 349	0,03
Commerzbank AG 0.50% 19 - 04.12.26	1 356 000	EUR	1 269 549	1 263 005	0,03
Commerzbank AG FRN 20 - 24.03.26	600 000	EUR	580 958	575 982	0,01
Commerzbank AG 0.875% 20 - 22.01.27	1 100 000	EUR	1 017 258	1 022 120	0,03
Commerzbank AG 1.00% 19 - 04.03.26	2 007 000	EUR	1 951 989	1 917 367	0,05
Commerzbank AG 1.125% 17 - 19.09.25	500 000	EUR	485 454	481 370	0,01
Commerzbank AG 1.125% 19 - 22.06.26	600 000	EUR	560 686	568 638	0,01
Commerzbank AG 1.50% 18 - 28.08.28	700 000	EUR	644 447	668 024	0,02
Commerzbank AG 1.875% 18 - 28.02.28	600 000	EUR	545 161	569 652	0,01
Commerzbank AG FRN 22 - 14.09.27	800 000	EUR	769 297	783 136	0,02
Commerzbank AG FRN 22 - 21.03.28	900 000	EUR	891 515	921 033	0,02
Commerzbank AG FRN 23 - 18.01.30	1 200 000	EUR	1 193 973	1 255 788	0,03
Commerzbank AG FRN 23 - 25.03.29	1 200 000	EUR	1 200 749	1 260 420	0,03
Continental AG 0.375% 19 - 27.06.25	714 000	EUR	688 808	686 004	0,02
Continental AG 2.50% 20 - 27.08.26	1 255 000	EUR	1 241 737	1 239 978	0,03
Continental AG 3.625% 22 - 30.11.27	1 006 000	EUR	995 920	1 022 176	0,03
Continental AG 4.00% 23 - 01.06.28	1 200 000	EUR	1 201 537	1 238 316	0,03
Continental AG 4.00% 23 - 01.03.27	900 000	EUR	897 897	920 484	0,02
Covestro AG 0.875% 20 - 03.02.26	851 000	EUR	812 430	815 556	0,02
Covestro AG 1.375% 20 - 12.06.30	500 000	EUR	438 530	450 810	0,01
Covestro AG 4.75% 22 - 15.11.28	800 000	EUR	811 693	852 192	0,02
Deutsche Bank AG FRN 21 - 17.02.27	1 600 000	EUR	1 521 839	1 494 096	0,04
Deutsche Bank AG 1.125% 15 - 17.03.25	1 000 000	EUR	977 047	969 120	0,03
Deutsche Bank AG FRN 20 - 10.06.26	927 000	EUR	902 782	898 504	0,02
Deutsche Bank AG FRN 20 - 03.09.26	1 400 000	EUR	1 339 360	1 340 808	0,03
Deutsche Bank AG FRN 21 - 17.02.32	3 000 000	EUR	2 410 023	2 464 230	0,06
Deutsche Bank AG 1.625% 20 - 20.01.27	2 300 000	EUR	2 173 961	2 161 241	0,06
Deutsche Bank AG 1.75% 18 - 17.01.28	1 200 000	EUR	1 091 597	1 112 532	0,03
Deutsche Bank AG FRN 20 - 19.11.30	2 600 000	EUR	2 249 475	2 259 478	0,06
Deutsche Bank AG FRN 22 - 23.02.28	1 900 000	EUR	1 755 840	1 785 791	0,05
Deutsche Bank AG 2.625% 19 - 12.02.26	1 300 000	EUR	1 268 570	1 275 430	0,03
Deutsche Bank AG 2.75% 15 - 17.02.25	1 800 000	EUR	1 775 961	1 776 672	0,05
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.05.28	800 000	EUR	768 913	782 936	0,02
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.06.32	2 500 000	EUR	2 251 158	2 404 250	0,06
Deutsche Bank AG 4.00% 22 - 29.11.27	1 100 000	EUR	1 098 724	1 130 855	0,03
Deutsche Bank AG 4.50% 16 - 19.05.26	1 300 000	EUR	1 282 519	1 319 604	0,03
Deutsche Bank AG FRN 22 - 05.09.30	2 400 000	EUR	2 351 149	2 478 912	0,06
Deutsche Bank AG FRN 23 - 11.01.29	900 000	EUR	910 860	941 940	0,02
Deutsche Bank AG FRN 20 - 19.05.31	1 900 000	EUR	1 857 350	1 922 249	0,05
Deutsche Boerse AG Zero Coupon 21 - 22.02.26	700 000	EUR	664 813	657 622	0,02
Deutsche Boerse AG 0.125% 21 - 22.02.31	500 000	EUR	446 297	415 205	0,01
Deutsche Boerse AG 1.125% 18 - 26.03.28	850 000	EUR	805 420	800 504	0,02
Deutsche Boerse AG FRN 20 - 16.06.47	900 000	EUR	811 551	813 105	0,02
Deutsche Boerse AG 1.50% 22 - 04.04.32	700 000	EUR	638 933	634 935	0,02
Deutsche Boerse AG 1.625% 15 - 08.10.25	450 000	EUR	437 303	440 392	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Deutsche Boerse AG FRN 22 - 23.06.48	800 000	EUR	720 074	723 472	0,02
Deutsche Boerse AG 3.75% 23 - 28.09.29	1 300 000	EUR	1 292 032	1 352 026	0,04
Deutsche Boerse AG 3.875% 23 - 28.09.26	1 700 000	EUR	1 699 507	1 737 111	0,05
Deutsche Boerse AG 3.875% 23 - 28.09.33	2 000 000	EUR	1 972 496	2 128 160	0,06
Deutsche Lufthansa AG 2.875% 21 - 16.05.27	1 300 000	EUR	1 253 379	1 249 053	0,03
Deutsche Lufthansa AG 3.00% 20 - 29.05.26	2 700 000	EUR	2 633 254	2 627 100	0,07
Deutsche Lufthansa AG 3.50% 21 - 14.07.29	700 000	EUR	682 554	681 261	0,02
Deutsche Lufthansa AG 3.75% 21 - 11.02.28	1 300 000	EUR	1 285 788	1 280 318	0,03
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.10% 21 - 02.02.26	700 000	EUR	639 529	627 081	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.25% 21 - 27.10.25	800 000	EUR	740 457	725 392	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.25% 22 - 17.01.25	800 000	EUR	770 995	757 336	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 4.375% 22 - 28.08.26	800 000	EUR	785 006	789 960	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 5.00% 23 - 05.02.27	700 000	EUR	711 598	716 870	0,02
Deutsche Post AG 0.375% 20 - 20.05.26	1 089 000	EUR	1 052 557	1 024 499	0,03
Deutsche Post AG 0.75% 20 - 20.05.29	1 018 000	EUR	929 668	930 269	0,02
Deutsche Post AG 1.00% 17 - 13.12.27	740 000	EUR	709 593	692 596	0,02
Deutsche Post AG 1.00% 20 - 20.05.32	1 011 000	EUR	869 995	899 355	0,02
Deutsche Post AG 1.25% 16 - 01.04.26	600 000	EUR	580 272	582 450	0,02
Deutsche Post AG 1.625% 18 - 05.12.28	1 120 000	EUR	1 089 975	1 066 453	0,03
Deutsche Post AG 3.375% 23 - 03.07.33	850 000	EUR	840 581	867 867	0,02
Deutsche Telekom AG 0.50% 19 - 05.07.27	1 526 000	EUR	1 455 035	1 424 246	0,04
Deutsche Telekom AG 0.875% 19 - 25.03.26	690 000	EUR	677 584	660 282	0,02
Deutsche Telekom AG 1.375% 19 - 05.07.34	1 200 000	EUR	1 020 094	1 037 136	0,03
Deutsche Telekom AG 1.75% 19 - 25.03.31	1 400 000	EUR	1 353 429	1 315 286	0,03
Deutsche Telekom AG 1.75% 19 - 09.12.49	1 110 000	EUR	800 384	872 693	0,02
Deutsche Telekom AG 2.25% 19 - 29.03.39	600 000	EUR	516 483	562 680	0,01
Deutsche Wohnen SE 0.50% 21 - 07.04.31	300 000	EUR	229 626	246 768	0,01
Deutsche Wohnen SE 1.00% 20 - 30.04.25	900 000	EUR	875 987	861 984	0,02
Deutsche Wohnen SE 1.30% 21 - 07.04.41	500 000	EUR	295 354	326 505	0,01
Deutsche Wohnen SE 1.50% 20 - 30.04.30	800 000	EUR	757 466	699 280	0,02
DVI Deutsche Vermoögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2.50% 22 - 25.01.27	600 000	EUR	530 036	516 186	0,01
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main 0.40% 21 - 17.11.28	200 000	EUR	176 565	170 564	0,00
E.ON SE 0.10% 21 - 19.12.28	696 000	EUR	628 618	621 500	0,02
E.ON SE 0.125% 22 - 18.01.26	929 000	EUR	881 379	875 415	0,02
E.ON SE 0.25% 19 - 24.10.26	971 000	EUR	912 436	906 914	0,02
E.ON SE 0.35% 19 - 28.02.30	970 000	EUR	856 318	823 336	0,02
E.ON SE 0.375% 20 - 29.09.27	1 680 000	EUR	1 579 497	1 534 361	0,04
E.ON SE 0.60% 21 - 01.10.32	980 000	EUR	824 384	796 603	0,02
E.ON SE 0.625% 19 - 07.11.31	791 000	EUR	662 312	657 250	0,02
E.ON SE 0.75% 20 - 18.12.30	439 000	EUR	369 841	383 936	0,01
E.ON SE 0.75% 20 - 20.02.28	699 000	EUR	637 977	647 540	0,02
E.ON SE 0.875% 20 - 20.08.31	907 000	EUR	774 055	772 900	0,02
E.ON SE 0.875% 22 - 18.10.34	1 100 000	EUR	824 521	885 247	0,02
E.ON SE 0.875% 22 - 08.01.25	1 118 000	EUR	1 092 279	1 089 871	0,03
E.ON SE 1.00% 20 - 07.10.25	1 286 000	EUR	1 250 112	1 240 977	0,03
E.ON SE 1.625% 17 - 22.05.29	1 036 000	EUR	956 450	975 694	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.625% 22 - 29.03.31	1 318 000	EUR	1 202 376	1 190 075	0,03
E.ON SE 2.875% 22 - 26.08.28	710 000	EUR	690 848	707 416	0,02
E.ON SE 3.50% 19 - 26.10.37	600 000	EUR	564 411	585 660	0,02
E.ON SE 3.50% 23 - 12.01.28	1 303 000	EUR	1 301 319	1 333 334	0,03
E.ON SE 3.75% 23 - 01.03.29	1 200 000	EUR	1 199 429	1 241 688	0,03
E.ON SE 3.875% 23 - 12.01.35	1 630 000	EUR	1 605 534	1 694 352	0,04
E.ON SE 4.00% 23 - 29.08.33	1 200 000	EUR	1 200 693	1 262 592	0,03
Eurogrid GmbH 0.741% 21 - 21.04.33	600 000	EUR	484 309	472 998	0,01
Eurogrid GmbH 1.113% 20 - 15.05.32	1 100 000	EUR	966 426	923 142	0,02
Eurogrid GmbH 1.50% 16 - 18.04.28	1 400 000	EUR	1 329 100	1 308 384	0,03
Eurogrid GmbH 1.875% 15 - 10.06.25	600 000	EUR	594 894	586 476	0,02
Eurogrid GmbH 3.279% 22 - 05.09.31	1 200 000	EUR	1 171 048	1 193 040	0,03
Eurogrid GmbH 3.722% 23 - 27.04.30	1 200 000	EUR	1 207 910	1 223 916	0,03
Evonik Industries AG 0.625% 20 - 18.09.25	1 000 000	EUR	963 258	955 220	0,02
Evonik Industries AG 0.75% 16 - 07.09.28	421 000	EUR	372 654	386 406	0,01
Evonik Industries AG 0.75% 16 - 07.09.28	200 000	EUR	177 978	183 566	0,00
Evonik Industries AG 2.25% 22 - 25.09.27	1 100 000	EUR	1 047 922	1 063 755	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 0.625% 19 - 30.11.26	1 170 000	EUR	1 102 972	1 070 585	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.00% 20 - 29.05.26	600 000	EUR	569 026	564 270	0,01
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.25% 19 - 29.11.29	785 000	EUR	684 064	683 264	0,02
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 18 - 11.07.25	932 000	EUR	897 069	899 678	0,02
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 20 - 29.05.30	1 010 000	EUR	879 105	871 590	0,02
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 3.875% 22 - 20.09.27	860 000	EUR	853 648	874 551	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 0.375% 20 - 28.09.26	900 000	EUR	824 555	836 550	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 0.75% 20 - 15.01.28	1 160 000	EUR	1 043 476	1 058 106	0,03
Fresenius SE & Co. KGaA 1.125% 20 - 28.01.33	800 000	EUR	617 758	650 968	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 1.625% 20 - 08.10.27	1 175 000	EUR	1 110 923	1 110 927	0,03
Fresenius SE & Co. KGaA 1.875% 19 - 15.02.25	780 000	EUR	772 641	764 650	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 1.875% 22 - 24.05.25	1 014 000	EUR	996 430	992 118	0,03
Fresenius SE & Co. KGaA 2.875% 19 - 15.02.29	720 000	EUR	697 709	713 520	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 2.875% 22 - 24.05.30	824 000	EUR	768 278	787 546	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 4.25% 22 - 28.05.26	800 000	EUR	799 921	817 864	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 5.00% 22 - 28.11.29	700 000	EUR	706 253	747 285	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 5.125% 23 - 05.10.30	800 000	EUR	824 592	861 392	0,02
Hamburg Commercial Bank AG 0.375% 21 - 09.03.26	700 000	EUR	639 212	643 195	0,02
Hamburg Commercial Bank AG FRN 21 - 22.09.26	900 000	EUR	817 765	828 999	0,02
Hamburg Commercial Bank AG 4.875% 23 - 17.03.25	1 200 000	EUR	1 198 996	1 203 108	0,03
Hamburg Commercial Bank AG 4.875% 23 - 30.03.27	700 000	EUR	696 615	707 623	0,02
Hamburger Sparkasse AG 4.375% 23 - 12.02.29	800 000	EUR	810 774	837 344	0,02
Hannover Rueck SE 1.125% 18 - 18.04.28	900 000	EUR	853 448	858 717	0,02
Hannover Rueck SE FRN 19 - 09.10.39	1 100 000	EUR	946 815	935 099	0,02
Hannover Rueck SE FRN 21 - 30.06.42	1 100 000	EUR	915 143	888 525	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Hannover Rueck SE FRN 20 - 08.10.40	700 000	EUR	604 594	602 861	0,02
Hannover Rueck SE FRN 14 - 29.06.49	700 000	EUR	685 729	687 589	0,02
Hannover Rueck SE FRN 22 - 26.08.43	1 100 000	EUR	1 140 783	1 227 303	0,03
HeidelbergCement AG 1.50% 16 - 07.02.25	1 174 000	EUR	1 157 665	1 152 046	0,03
HeidelbergCement AG 3.75% 23 - 31.05.32	1 253 000	EUR	1 187 118	1 265 593	0,03
Hella GmbH & Co. KGaA 0.50% 19 - 26.01.27	583 000	EUR	531 276	531 230	0,01
Henkel AG & Co. KGaA 0.50% 21 - 17.11.32	500 000	EUR	408 373	414 560	0,01
Henkel AG & Co. KGaA 2.625% 22 - 13.09.27	1 200 000	EUR	1 171 845	1 193 172	0,03
Heraeus Finance GmbH 2.625% 22 - 09.06.27	700 000	EUR	671 196	679 630	0,02
HOCHTIEF AG 0.50% 19 - 03.09.27	768 000	EUR	691 618	697 559	0,02
HOCHTIEF AG 0.625% 21 - 26.04.29	700 000	EUR	581 635	605 752	0,02
HOCHTIEF AG 1.75% 18 - 03.07.25	905 000	EUR	883 506	880 357	0,02
Infineon Technologies AG 0.625% 22 - 17.02.25	600 000	EUR	586 226	579 660	0,02
Infineon Technologies AG 1.125% 20 - 24.06.26	1 400 000	EUR	1 339 527	1 332 002	0,03
Infineon Technologies AG 1.625% 20 - 24.06.29	1 200 000	EUR	1 132 500	1 112 028	0,03
Infineon Technologies AG 2.00% 20 - 24.06.32	1 000 000	EUR	896 980	908 090	0,02
KION Group AG 1.625% 20 - 24.09.25	800 000	EUR	763 596	761 608	0,02
Knorr-Bremse AG 1.125% 18 - 13.06.25	1 200 000	EUR	1 163 874	1 164 192	0,03
Knorr-Bremse AG 3.25% 22 - 21.09.27	1 100 000	EUR	1 082 231	1 108 866	0,03
LANXESS AG Zero Coupon 21 - 08.09.27	858 000	EUR	759 597	744 092	0,02
LANXESS AG 0.625% 21 - 01.12.29	1 000 000	EUR	852 754	813 610	0,02
LANXESS AG 1.00% 16 - 07.10.26	503 000	EUR	485 201	473 524	0,01
LANXESS AG 1.125% 18 - 16.05.25	942 000	EUR	913 706	909 143	0,02
LANXESS AG 1.75% 22 - 22.03.28	800 000	EUR	729 765	732 584	0,02
LEG Immobilien SE 0.375% 22 - 17.01.26	800 000	EUR	749 626	748 880	0,02
LEG Immobilien SE 0.75% 21 - 30.06.31	1 200 000	EUR	959 925	951 588	0,02
LEG Immobilien SE 0.875% 19 - 28.11.27	1 100 000	EUR	979 383	995 038	0,03
LEG Immobilien SE 0.875% 21 - 30.03.33	900 000	EUR	705 572	679 203	0,02
LEG Immobilien SE 0.875% 22 - 17.01.29	800 000	EUR	690 769	699 168	0,02
LEG Immobilien SE 1.00% 21 - 19.11.32	800 000	EUR	628 586	622 512	0,02
LEG Immobilien SE 1.50% 22 - 17.01.34	700 000	EUR	555 197	549 206	0,01
LEG Immobilien SE 1.625% 19 - 28.11.34	400 000	EUR	319 477	304 772	0,01
Mercedes-Benz Group AG 0.75% 19 - 08.02.30	1 286 000	EUR	1 144 662	1 127 398	0,03
Mercedes-Benz Group AG 0.75% 20 - 10.09.30	1 436 000	EUR	1 270 632	1 245 759	0,03
Mercedes-Benz Group AG 0.75% 21 - 11.03.33	1 800 000	EUR	1 481 645	1 485 288	0,04
Mercedes-Benz Group AG 1.00% 17 - 15.11.27	1 226 000	EUR	1 184 355	1 146 641	0,03
Mercedes-Benz Group AG 1.125% 19 - 08.08.34	653 000	EUR	514 359	540 429	0,01
Mercedes-Benz Group AG 1.125% 19 - 06.11.31	1 000 000	EUR	862 216	875 050	0,02
Mercedes-Benz Group AG 1.125% 19 - 06.11.31	466 000	EUR	412 805	407 773	0,01
Mercedes-Benz Group AG 1.375% 16 - 11.05.28	2 100 000	EUR	1 977 048	1 981 728	0,05
Mercedes-Benz Group AG 1.50% 17 - 03.07.29	2 159 000	EUR	2 041 732	2 019 680	0,05
Mercedes-Benz Group AG 2.00% 19 - 27.02.31	1 130 000	EUR	1 060 557	1 080 461	0,03
Mercedes-Benz Group AG 2.125% 17 - 03.07.37	1 900 000	EUR	1 739 526	1 717 182	0,04
Mercedes-Benz Group AG 2.375% 20 - 22.05.30	1 056 000	EUR	1 004 830	1 018 702	0,03
Merck Financial Services GmbH 0.125% 20 - 16.07.25	1 000 000	EUR	965 906	951 740	0,02
Merck Financial Services GmbH 0.375% 19 - 05.07.27	700 000	EUR	675 818	642 957	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Merck Financial Services GmbH 0.50% 20 - 16.07.28	1 100 000	EUR	1 003 712	989 087	0,03
Merck Financial Services GmbH 0.875% 19 - 05.07.31	1 200 000	EUR	1 025 770	1 033 404	0,03
Merck Financial Services GmbH 1.875% 22 - 15.06.26	900 000	EUR	875 493	876 933	0,02
Merck Financial Services GmbH 2.375% 22 - 15.06.30	900 000	EUR	851 102	871 695	0,02
Merck KGaA FRN 20 - 09.09.80	1 300 000	EUR	1 217 261	1 206 101	0,03
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	900 000	EUR	819 912	826 038	0,02
METRO AG 1.50% 15 - 19.03.25	808 000	EUR	791 584	783 687	0,02
MTU Aero Engines AG 3.00% 20 - 01.07.25	726 000	EUR	717 443	719 669	0,02
Muenchener Hypothekenbank eG 0.375% 21 - 09.03.29	600 000	EUR	516 345	509 106	0,01
Muenchener Hypothekenbank eG 0.50% 19 - 08.06.26	500 000	EUR	466 439	461 070	0,01
Muenchener Hypothekenbank eG 0.875% 18 - 12.09.25	700 000	EUR	674 716	665 063	0,02
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 21 - 26.05.42	1 600 000	EUR	1 324 543	1 261 440	0,03
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 20 - 26.05.41	1 800 000	EUR	1 502 113	1 491 930	0,04
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 18 - 26.05.49	1 900 000	EUR	1 853 386	1 839 903	0,05
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 18 - 05.07.25	1 100 000	EUR	1 070 024	1 069 915	0,03
Oldenburgische Landesbank AG 5.625% 23 - 02.02.26	700 000	EUR	694 420	703 885	0,02
Robert Bosch GmbH 3.625% 23 - 02.06.27	1 300 000	EUR	1 298 548	1 327 677	0,03
Robert Bosch GmbH 3.625% 23 - 02.06.30	1 500 000	EUR	1 491 884	1 539 345	0,04
Robert Bosch GmbH 4.00% 23 - 02.06.35	1 800 000	EUR	1 810 415	1 907 370	0,05
Robert Bosch GmbH 4.375% 23 - 02.06.43	2 300 000	EUR	2 318 976	2 467 877	0,06
RWE AG 0.50% 21 - 26.11.28	1 090 000	EUR	987 306	971 800	0,03
RWE AG 0.625% 21 - 11.06.31	800 000	EUR	645 612	670 152	0,02
RWE AG 1.00% 21 - 26.11.33	780 000	EUR	610 957	622 986	0,02
RWE AG 2.125% 22 - 24.05.26	1 453 000	EUR	1 419 773	1 420 700	0,04
RWE AG 2.50% 22 - 24.08.25	2 000 000	EUR	1 972 114	1 972 240	0,05
RWE AG 2.75% 22 - 24.05.30	1 553 000	EUR	1 470 918	1 502 046	0,04
RWE AG 3.625% 23 - 13.02.29	660 000	EUR	651 541	681 127	0,02
RWE AG 4.125% 23 - 13.02.35	770 000	EUR	739 235	799 768	0,02
Santander Consumer Bank AG 4.375% 23 - 13.09.27	1 000 000	EUR	1 003 173	1 030 620	0,03
Santander Consumer Bank AG 4.50% 23 - 30.06.26	800 000	EUR	801 764	817 928	0,02
SAP SE 0.125% 20 - 18.05.26	1 100 000	EUR	1 033 688	1 034 935	0,03
SAP SE 0.375% 20 - 18.05.29	1 200 000	EUR	1 088 514	1 067 508	0,03
SAP SE 1.00% 15 - 01.04.25	800 000	EUR	784 595	783 352	0,02
SAP SE 1.00% 18 - 13.03.26	600 000	EUR	592 966	578 142	0,02
SAP SE 1.25% 18 - 10.03.28	1 400 000	EUR	1 362 772	1 326 486	0,03
SAP SE 1.375% 18 - 13.03.30	600 000	EUR	560 994	555 414	0,01
SAP SE 1.625% 18 - 10.03.31	1 900 000	EUR	1 782 182	1 772 453	0,05
SAP SE 1.75% 14 - 22.02.27	1 300 000	EUR	1 281 653	1 288 924	0,03
Talanx AG FRN 21 - 01.12.42	700 000	EUR	559 862	578 865	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Talanx AG FRN 17 - 05.12.47	1 200 000	EUR	1 120 675	1 119 120	0,03
Talanx AG 2.50% 14 - 23.07.26	500 000	EUR	487 947	490 920	0,01
Talanx AG 4.00% 22 - 25.10.29	1 000 000	EUR	1 004 763	1 041 530	0,03
Vier Gas Transport GmbH 0.125% 19 - 10.09.29	500 000	EUR	408 592	427 455	0,01
Vier Gas Transport GmbH 0.50% 19 - 10.09.34	800 000	EUR	573 447	588 976	0,02
Vier Gas Transport GmbH 1.50% 18 - 25.09.28	500 000	EUR	461 155	466 480	0,01
Vier Gas Transport GmbH 2.875% 13 - 12.06.25	1 150 000	EUR	1 139 737	1 145 250	0,03
Vier Gas Transport GmbH 4.00% 22 - 26.09.27	1 000 000	EUR	996 117	1 027 980	0,03
Vier Gas Transport GmbH 4.625% 22 - 26.09.32	900 000	EUR	914 766	979 101	0,03
Volkswagen Bank GmbH 1.25% 17 - 15.12.25	700 000	EUR	669 682	672 581	0,02
Volkswagen Bank GmbH 2.50% 19 - 31.07.26	1 300 000	EUR	1 261 588	1 266 577	0,03
Volkswagen Bank GmbH 4.25% 23 - 07.01.26	1 500 000	EUR	1 496 918	1 517 835	0,04
Volkswagen Bank GmbH 4.375% 23 - 03.05.28	800 000	EUR	794 580	824 872	0,02
Volkswagen Bank GmbH 4.625% 23 - 03.05.31	800 000	EUR	792 432	838 896	0,02
Volkswagen Financial Services AG Zero Coupon 21 - 12.02.25	1 311 000	EUR	1 274 361	1 258 993	0,03
Volkswagen Financial Services AG 0.125% 21 - 12.02.27	1 500 000	EUR	1 372 567	1 361 985	0,04
Volkswagen Financial Services AG 0.25% 22 - 31.01.25	1 400 000	EUR	1 357 564	1 350 034	0,04
Volkswagen Financial Services AG 0.375% 21 - 12.02.30	1 100 000	EUR	895 611	908 798	0,02
Volkswagen Financial Services AG 0.875% 22 - 31.01.28	1 557 000	EUR	1 414 114	1 408 820	0,04
Volkswagen Financial Services AG 2.25% 18 - 16.10.26	855 000	EUR	848 170	834 907	0,02
Volkswagen Financial Services AG 2.25% 19 - 01.10.27	900 000	EUR	875 892	876 321	0,02
Volkswagen Financial Services AG 3.00% 20 - 06.04.25	804 000	EUR	807 782	799 080	0,02
Volkswagen Financial Services AG 3.375% 20 - 06.04.28	1 147 000	EUR	1 149 424	1 155 947	0,03
Volkswagen Leasing GmbH 0.25% 21 - 12.01.26	1 311 000	EUR	1 225 753	1 229 246	0,03
Volkswagen Leasing GmbH 0.375% 21 - 20.07.26	1 637 000	EUR	1 537 230	1 517 875	0,04
Volkswagen Leasing GmbH 0.50% 21 - 12.01.29	1 022 000	EUR	916 474	886 360	0,02
Volkswagen Leasing GmbH 0.625% 21 - 19.07.29	1 318 000	EUR	1 135 868	1 132 333	0,03
Volkswagen Leasing GmbH 1.375% 17 - 20.01.25	1 400 000	EUR	1 378 714	1 365 896	0,04
Volkswagen Leasing GmbH 1.50% 19 - 19.06.26	834 000	EUR	796 674	797 946	0,02
Volkswagen Leasing GmbH 1.625% 18 - 15.08.25	1 282 000	EUR	1 255 257	1 245 066	0,03
Volkswagen Leasing GmbH 4.50% 23 - 25.03.26	1 020 000	EUR	1 021 402	1 042 318	0,03
Volkswagen Leasing GmbH 4.625% 23 - 25.03.29	880 000	EUR	876 467	928 101	0,02
Volkswagen Leasing GmbH 4.75% 23 - 25.09.31	1 260 000	EUR	1 252 132	1 343 966	0,03
Vonovia SE Zero Coupon 21 - 01.12.25	1 800 000	EUR	1 698 340	1 678 302	0,04
Vonovia SE 0.25% 21 - 01.09.28	1 700 000	EUR	1 477 106	1 443 436	0,04
Vonovia SE 0.375% 21 - 16.06.27	1 600 000	EUR	1 453 208	1 430 400	0,04
Vonovia SE 0.625% 21 - 24.03.31	900 000	EUR	706 276	709 218	0,02
Vonovia SE 0.625% 21 - 14.12.29	1 700 000	EUR	1 448 702	1 402 211	0,04
Vonovia SE 0.75% 21 - 01.09.32	1 900 000	EUR	1 568 534	1 443 715	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Vonovia SE 1.00% 21 - 16.06.33	1 500 000	EUR	1 227 672	1 139 085	0,03
Vonovia SE 1.375% 22 - 28.01.26	900 000	EUR	859 560	860 166	0,02
Vonovia SE 1.50% 21 - 14.06.41	700 000	EUR	466 811	455 210	0,01
Vonovia SE 1.625% 21 - 01.09.51	1 100 000	EUR	794 031	636 581	0,02
Vonovia SE 1.875% 22 - 28.06.28	1 300 000	EUR	1 217 017	1 201 044	0,03
Vonovia SE 2.375% 22 - 25.03.32	1 100 000	EUR	984 845	964 458	0,03
Vonovia SE 4.75% 22 - 23.05.27	1 100 000	EUR	1 104 193	1 140 689	0,03
Vonovia SE 5.00% 22 - 23.11.30	1 100 000	EUR	1 105 077	1 162 755	0,03
WPP Finance Deutschland GmbH 1.625% 15 - 23.03.30	700 000	EUR	637 723	637 784	0,02
Wuestenrot & Wuerttembergische AG FRN 21 - 10.09.41	500 000	EUR	365 374	373 715	0,01
			334 136 794	336 103 238	8,70
Guernesey					
Pershing Square Holdings Ltd. 1.375% 21 - 01.10.27	1 000 000	EUR	864 107	885 020	0,02
Sirius Real Estate Ltd. 1.125% 21 - 22.06.26	800 000	EUR	705 569	721 304	0,02
Sirius Real Estate Ltd. 1.75% 21 - 24.11.28	400 000	EUR	316 759	330 628	0,01
			1 886 435	1 936 952	0,05
Hong Kong					
AIA Group Ltd. FRN 21 - 09.09.33	1 162 000	EUR	966 914	991 128	0,03
			966 914	991 128	0,03
Hongrie					
Erste Bank Hungary Zrt FRN 22 - 04.02.26	300 000	EUR	279 144	286 197	0,01
MOL Hungarian Oil & Gas PLC 1.50% 20 - 08.10.27	929 000	EUR	826 595	840 568	0,02
OTP Bank Nyrt FRN 23 - 05.10.27	1 100 000	EUR	1 098 677	1 137 477	0,03
OTP Bank Nyrt FRN 22 - 04.03.26	726 000	EUR	728 846	745 290	0,02
			2 933 262	3 009 532	0,08
Islande					
Arion Banki HF 0.375% 21 - 14.07.25	500 000	EUR	464 641	468 770	0,01
Arion Banki HF 7.25% 23 - 25.05.26	300 000	EUR	302 192	315 924	0,01
			766 833	784 694	0,02
Irlande					
Abbott Ireland Financing Dac 0.375% 19 - 19.11.27	1 100 000	EUR	990 271	1 007 490	0,03
Abbott Ireland Financing Dac 1.50% 18 - 27.09.26	1 562 000	EUR	1 526 796	1 507 408	0,04
AIB Group PLC FRN 21 - 17.11.27	992 000	EUR	915 709	910 239	0,02
AIB Group PLC 2.25% 18 - 03.07.25	900 000	EUR	877 514	884 376	0,02
AIB Group PLC FRN 22 - 04.04.28	1 300 000	EUR	1 218 492	1 246 687	0,03
AIB Group PLC FRN 22 - 04.07.26	1 200 000	EUR	1 190 198	1 200 048	0,03
AIB Group PLC FRN 23 - 23.07.29	953 000	EUR	948 241	983 372	0,03
AIB Group PLC FRN 23 - 23.10.31	1 480 000	EUR	1 484 042	1 598 696	0,04
AIB Group PLC FRN 22 - 16.02.29	1 000 000	EUR	1 031 223	1 074 840	0,03
Atlas Copco Finance Dac 0.125% 19 - 03.09.29	730 000	EUR	616 244	626 858	0,02
Atlas Copco Finance Dac 0.75% 22 - 08.02.32	500 000	EUR	417 143	419 850	0,01
Bank of Ireland Group PLC FRN 21 - 10.05.27	1 200 000	EUR	1 103 261	1 115 532	0,03
Bank of Ireland Group PLC FRN 21 - 11.08.31	800 000	EUR	711 867	746 016	0,02
Bank of Ireland Group PLC FRN 22 - 05.06.26	1 400 000	EUR	1 349 758	1 361 570	0,03
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 13.11.29	800 000	EUR	811 755	831 208	0,02
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 16.07.28	1 353 000	EUR	1 366 900	1 414 575	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 04.07.31	1 230 000	EUR	1 237 979	1 312 275	0,03
Bank of Ireland Group PLC FRN 22 - 01.03.33	800 000	EUR	825 702	864 464	0,02
CA Auto Bank SpA 4.375% 23 - 08.06.26	1 100 000	EUR	1 100 598	1 117 347	0,03
CA Auto Bank SpA 4.75% 23 - 25.01.27	950 000	EUR	957 663	981 531	0,03
CCEP Finance Ireland Dac Zero Coupon 21 - 06.09.25	1 500 000	EUR	1 430 121	1 418 670	0,04
CCEP Finance Ireland Dac 0.50% 21 - 06.09.29	1 020 000	EUR	920 190	883 371	0,02
CCEP Finance Ireland Dac 0.875% 21 - 06.05.33	1 760 000	EUR	1 491 525	1 421 886	0,04
CCEP Finance Ireland Dac 1.50% 21 - 06.05.41	1 040 000	EUR	748 332	771 295	0,02
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 1.50% 18 - 15.12.28	926 000	EUR	899 400	869 227	0,02
CRH Finance Dac 1.375% 16 - 18.10.28	800 000	EUR	745 822	739 968	0,02
CRH SMW Finance Dac 1.25% 20 - 05.11.26	1 100 000	EUR	1 059 130	1 048 080	0,03
CRH SMW Finance DAC 4.00% 23 - 11.07.27	800 000	EUR	806 525	822 080	0,02
CRH SMW Finance DAC 4.00% 23 - 11.07.31	1 100 000	EUR	1 094 892	1 142 416	0,03
CRH SMW Finance DAC 4.25% 23 - 11.07.35	1 200 000	EUR	1 195 745	1 261 020	0,03
Dell Bank International Dac 0.50% 21 - 27.10.26	705 000	EUR	646 863	652 210	0,02
Dell Bank International Dac 4.50% 22 - 18.10.27	700 000	EUR	705 279	729 225	0,02
DXC Capital Funding Dac 0.45% 21 - 15.09.27	1 200 000	EUR	1 060 958	1 065 216	0,03
DXC Capital Funding Dac 0.95% 21 - 15.09.31	800 000	EUR	623 284	640 512	0,02
Eaton Capital UnLtd Co. 0.128% 21 - 08.03.26	1 630 000	EUR	1 536 780	1 529 739	0,04
Eaton Capital UnLtd Co. 0.577% 21 - 08.03.30	900 000	EUR	776 898	777 069	0,02
Eaton Capital UnLtd Co. 0.697% 19 - 14.05.25	667 000	EUR	646 337	642 574	0,02
Experian Europe Dac 1.56% 22 - 16.05.31	610 000	EUR	539 833	549 201	0,01
Fresenius Finance Ireland PLC Zero Coupon 21 - 01.10.25	600 000	EUR	571 213	564 996	0,01
Fresenius Finance Ireland PLC 0.50% 21 - 01.10.28	549 000	EUR	489 731	486 452	0,01
Fresenius Finance Ireland PLC 0.875% 21 - 01.10.31	749 000	EUR	613 969	605 529	0,02
Fresenius Finance Ireland PLC 2.125% 17 - 01.02.27	1 100 000	EUR	1 077 450	1 064 129	0,03
Fresenius Finance Ireland PLC 3.00% 17 - 30.01.32	806 000	EUR	765 055	763 443	0,02
GE Capital European Funding Unlimited Co. 6.025% 08 - 01.03.38	700 000	EUR	905 374	874 286	0,02
Glencore Capital Finance Dac 0.75% 21 - 01.03.29	671 000	EUR	575 495	587 554	0,01
Glencore Capital Finance Dac 1.125% 20 - 10.03.28	1 096 000	EUR	1 007 538	1 009 471	0,03
Glencore Capital Finance Dac 1.25% 21 - 01.03.33	993 000	EUR	775 818	798 720	0,02
Hammerson Ireland Finance Dac 1.75% 21 - 03.06.27	1 000 000	EUR	862 042	915 640	0,02
Johnson Controls International PLC 1.375% 16 - 25.02.25	550 000	EUR	535 984	534 908	0,01
Johnson Controls International PLC 4.25% 23 - 23.05.35	1 200 000	EUR	1 199 208	1 271 988	0,03
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 0.375% 20 - 15.09.27	834 000	EUR	752 887	752 818	0,02
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 1.00% 20 - 15.09.32	800 000	EUR	633 835	666 672	0,02
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 3.00% 22 - 15.09.28	961 000	EUR	930 648	957 070	0,02
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 0.625% 19 - 20.09.29	1 262 000	EUR	1 101 318	1 112 302	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 0.875% 21 - 01.12.31	890 000	EUR	742 511	754 551	0,02
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 2.375% 15 - 10.09.25	1 485 000	EUR	1 469 254	1 465 101	0,04
Linde PLC Zero Coupon 21 - 30.09.26	1 000 000	EUR	933 455	923 350	0,02
Linde PLC 0.375% 21 - 30.09.33	800 000	EUR	617 147	622 096	0,02
Linde PLC 1.00% 21 - 30.09.51	1 000 000	EUR	629 477	605 990	0,02
Linde PLC 1.00% 22 - 31.03.27	900 000	EUR	847 342	850 698	0,02
Linde PLC 1.375% 22 - 31.03.31	1 200 000	EUR	1 100 268	1 081 860	0,03
Linde PLC 1.625% 22 - 31.03.35	1 200 000	EUR	1 041 198	1 030 272	0,03
Linde PLC 3.375% 23 - 12.06.29	1 100 000	EUR	1 088 944	1 130 107	0,03
Linde PLC 3.625% 23 - 12.06.25	700 000	EUR	699 203	704 256	0,02
Linde PLC 3.625% 23 - 12.06.34	900 000	EUR	888 497	942 273	0,02
PartnerRe Ireland Finance Dac 1.25% 16 - 15.09.26	1 122 000	EUR	1 059 115	1 059 774	0,03
Roadster Finance Dac 2.375% 17 - 08.12.27	500 000	EUR	429 163	429 965	0,01
Ryanair Dac 0.875% 21 - 25.05.26	1 647 000	EUR	1 563 714	1 554 834	0,04
Ryanair Dac 2.875% 20 - 15.09.25	1 396 000	EUR	1 384 687	1 382 501	0,04
Securitas Treasury Ireland DAC 4.25% 23 - 04.04.27	880 000	EUR	882 748	896 799	0,02
Securitas Treasury Ireland DAC 4.375% 23 - 06.03.29	1 010 000	EUR	1 008 606	1 044 451	0,03
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.875% 18 - 15.01.26	1 500 000	EUR	1 487 716	1 477 785	0,04
Smurfit Kappa Treasury ULC 0.50% 21 - 22.09.29	608 000	EUR	520 246	520 010	0,01
Smurfit Kappa Treasury ULC 1.00% 21 - 22.09.33	808 000	EUR	653 154	645 099	0,02
Smurfit Kappa Treasury ULC 1.50% 19 - 15.09.27	1 000 000	EUR	932 705	938 990	0,02
Transmission Finance Dac 0.375% 21 - 18.06.28	594 000	EUR	508 541	518 645	0,01
Vodafone International Financing Dac 3.25% 22 - 02.03.29	850 000	EUR	835 268	860 642	0,02
Vodafone International Financing Dac 3.75% 22 - 02.12.34	970 000	EUR	940 111	1 000 604	0,03
Vodafone International Financing Dac 4.00% 23 - 10.02.43	800 000	EUR	739 292	810 432	0,02
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 1.625% 19 - 17.06.39	820 000	EUR	627 072	662 724	0,02
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. FRN 20 - 17.09.50	1 100 000	EUR	932 377	957 407	0,02
			74 968 646	76 005 335	1,97
Italie					
2i Rete Gas SpA 0.579% 21 - 29.01.31	913 000	EUR	758 441	746 231	0,02
2i Rete Gas SpA 1.608% 17 - 31.10.27	1 100 000	EUR	1 065 748	1 033 868	0,03
2i Rete Gas SpA 1.75% 17 - 28.08.26	600 000	EUR	566 643	576 432	0,01
2i Rete Gas SpA 2.195% 18 - 11.09.25	620 000	EUR	617 112	607 650	0,02
2i Rete Gas SpA 4.375% 23 - 06.06.33	810 000	EUR	801 943	829 278	0,02
Aeroporti di Roma SpA 1.625% 17 - 08.06.27	600 000	EUR	569 135	575 526	0,01
Aeroporti di Roma SpA 1.625% 20 - 02.02.29	350 000	EUR	311 211	321 202	0,01
Aeroporti di Roma SpA 1.75% 21 - 30.07.31	890 000	EUR	750 273	767 563	0,02
Aeroporti di Roma SpA 4.875% 23 - 10.07.33	600 000	EUR	588 051	631 476	0,02
Anima Holdings SpA 1.50% 21 - 22.04.28	305 000	EUR	268 848	274 491	0,01
Assicurazioni Generali SpA 1.713% 21 - 30.06.32	800 000	EUR	623 244	644 256	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.124% 19 - 01.10.30	1 050 000	EUR	934 677	925 008	0,02
Assicurazioni Generali SpA 2.429% 20 - 14.07.31	900 000	EUR	777 666	785 961	0,02
Assicurazioni Generali SpA 3.875% 19 - 29.01.29	666 000	EUR	648 457	673 140	0,02
Assicurazioni Generali SpA 4.125% 14 - 04.05.26	1 300 000	EUR	1 330 969	1 308 658	0,03
Assicurazioni Generali SpA FRN 14 - 30.11.49	1 400 000	EUR	1 402 791	1 393 518	0,04
Assicurazioni Generali SpA FRN 16 - 08.06.48	1 300 000	EUR	1 354 988	1 339 377	0,03
Assicurazioni Generali SpA 5.272% 23 - 12.09.33	900 000	EUR	869 564	948 762	0,02
Assicurazioni Generali SpA 5.399% 23 - 20.04.33	700 000	EUR	703 785	742 938	0,02
Assicurazioni Generali SpA FRN 15 - 27.10.47	1 800 000	EUR	1 903 969	1 870 056	0,05
Assicurazioni Generali SpA 5.80% 22 - 06.07.32	600 000	EUR	629 751	647 136	0,02
ASTM SpA 1.00% 21 - 25.11.26	990 000	EUR	914 120	922 829	0,02
ASTM SpA 1.50% 21 - 25.01.30	1 916 000	EUR	1 671 503	1 665 905	0,04
ASTM SpA 1.625% 18 - 08.02.28	700 000	EUR	638 598	656 565	0,02
ASTM SpA 2.375% 21 - 25.11.33	1 600 000	EUR	1 375 411	1 342 464	0,03
Autostrade per l'Italia SpA 1.625% 22 - 25.01.28	700 000	EUR	620 072	642 908	0,02
Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 15 - 26.06.26	1 100 000	EUR	1 033 700	1 047 728	0,03
Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 16 - 01.02.27	900 000	EUR	825 863	851 976	0,02
Autostrade per l'Italia SpA 1.875% 15 - 04.11.25	800 000	EUR	767 032	774 568	0,02
Autostrade per l'Italia SpA 1.875% 17 - 26.09.29	1 100 000	EUR	933 303	978 175	0,02
Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 20 - 04.12.28	2 000 000	EUR	1 749 950	1 837 380	0,05
Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 21 - 15.01.30	1 400 000	EUR	1 175 007	1 240 302	0,03
Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 22 - 25.01.32	800 000	EUR	646 831	686 976	0,02
Autostrade per l'Italia SpA 4.375% 10 - 16.09.25	700 000	EUR	701 222	707 854	0,02
Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 23 - 24.01.31	1 153 000	EUR	1 134 966	1 187 936	0,03
Autostrade per l'Italia SpA 5.125% 23 - 14.06.33	1 100 000	EUR	1 094 193	1 150 336	0,03
Banca Mediolanum SpA FRN 22 - 22.01.27	500 000	EUR	503 667	515 445	0,01
Banco BPM SpA 0.875% 21 - 15.07.26	900 000	EUR	837 250	843 777	0,02
Banco BPM SpA 4.625% 23 - 29.11.27	1 400 000	EUR	1 415 256	1 443 148	0,04
Banco BPM SpA 4.875% 23 - 18.01.27	1 000 000	EUR	1 023 017	1 032 290	0,03
Cassa Centrale Banca - Credito Cooperativo Italiano SpA FRN 23 - 16.02.27	570 000	EUR	572 956	590 241	0,01
Credito Emiliano SpA FRN 22 - 19.01.28	634 000	EUR	588 398	587 369	0,01
Credito Emiliano SpA FRN 23 - 26.03.30	900 000	EUR	887 845	928 719	0,02
Enel SpA FRN 21 - 31.12.99	1 900 000	EUR	1 637 934	1 658 947	0,04
Enel SpA FRN 21 - 31.12.99	1 600 000	EUR	1 302 034	1 266 576	0,03
Enel SpA FRN 20 - 31.12.99	862 000	EUR	791 526	789 023	0,02
Enel SpA FRN 18 - 24.11.81	1 061 000	EUR	1 010 637	1 010 263	0,03
Enel SpA FRN 19 - 24.05.80	1 300 000	EUR	1 267 416	1 276 496	0,03
Enel SpA 5.625% 07 - 21.06.27	1 300 000	EUR	1 418 915	1 401 478	0,04
Enel SpA FRN 23 - 31.12.99	1 400 000	EUR	1 422 088	1 462 412	0,04
Enel SpA FRN 23 - 31.12.99	1 153 000	EUR	1 171 013	1 225 800	0,03
Eni SpA 0.375% 21 - 14.06.28	1 681 000	EUR	1 509 945	1 496 510	0,04
Eni SpA 0.625% 20 - 23.01.30	1 430 000	EUR	1 287 277	1 231 287	0,03
Eni SpA 1.00% 17 - 14.03.25	859 000	EUR	845 998	833 934	0,02
Eni SpA 1.00% 19 - 11.10.34	1 136 000	EUR	863 605	880 116	0,02
Eni SpA 1.125% 16 - 19.09.28	700 000	EUR	655 099	643 993	0,02
Eni SpA 1.25% 20 - 18.05.26	1 214 000	EUR	1 178 647	1 163 680	0,03
Eni SpA 1.50% 15 - 02.02.26	1 700 000	EUR	1 655 270	1 635 995	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Eni SpA 1.50% 17 - 17.01.27	1 200 000	EUR	1 162 357	1 146 264	0,03
Eni SpA 1.625% 16 - 17.05.28	1 300 000	EUR	1 209 303	1 224 470	0,03
Eni SpA 2.00% 20 - 18.05.31	1 454 000	EUR	1 338 005	1 333 623	0,03
Eni SpA FRN 21 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 328 683	1 367 685	0,03
Eni SpA FRN 20 - 31.12.99	2 200 000	EUR	2 115 836	2 111 164	0,05
Eni SpA FRN 21 - 31.12.99	1 489 000	EUR	1 274 811	1 279 602	0,03
Eni SpA FRN 20 - 31.12.99	2 231 000	EUR	2 070 787	2 045 113	0,05
Eni SpA 3.625% 14 - 29.01.29	1 432 000	EUR	1 474 821	1 470 864	0,04
Eni SpA 3.625% 23 - 19.05.27	1 000 000	EUR	993 856	1 015 370	0,03
Eni SpA 3.75% 13 - 12.09.25	2 000 000	EUR	2 029 462	2 012 500	0,05
Eni SpA 4.25% 23 - 19.05.33	1 900 000	EUR	1 890 683	1 993 993	0,05
ERG SpA 0.50% 20 - 11.09.27	1 047 000	EUR	945 718	945 650	0,02
ERG SpA 0.875% 21 - 15.09.31	708 000	EUR	571 679	568 510	0,01
ERG SpA 1.875% 19 - 11.04.25	799 000	EUR	785 103	783 236	0,02
FinecoBank Banca Fineco SpA FRN 21 - 21.10.27	528 000	EUR	475 736	480 733	0,01
FinecoBank Banca Fineco SpA FRN 23 - 23.02.29	600 000	EUR	591 651	611 766	0,02
Genertel SpA FRN 17 - 14.12.47	900 000	EUR	864 994	893 196	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 0.625% 21 - 24.02.26	1 650 000	EUR	1 553 062	1 551 066	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 21 - 16.03.28	1 730 000	EUR	1 560 073	1 558 349	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 19.11.26	1 921 000	EUR	1 810 260	1 800 784	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 1.35% 21 - 24.02.31	1 150 000	EUR	948 727	942 413	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 1.625% 19 - 21.04.25	750 000	EUR	743 224	731 798	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 18 - 20.03.28	1 900 000	EUR	1 797 259	1 774 163	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 19 - 04.07.29	1 600 000	EUR	1 466 528	1 457 616	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 20 - 26.05.25	2 118 000	EUR	2 081 932	2 075 704	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23 - 19.05.26	1 600 000	EUR	1 596 988	1 623 424	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 4.375% 23 - 29.08.27	1 400 000	EUR	1 401 031	1 436 792	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 4.75% 22 - 06.09.27	1 400 000	EUR	1 399 384	1 451 240	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 4.875% 23 - 19.05.30	2 000 000	EUR	1 997 540	2 103 580	0,05
Intesa Sanpaolo SpA FRN 23 - 08.03.28	2 260 000	EUR	2 251 103	2 338 060	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 5.125% 23 - 29.08.31	2 200 000	EUR	2 231 104	2 347 708	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 5.25% 22 - 13.01.30	1 101 000	EUR	1 132 596	1 181 098	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 5.625% 23 - 08.03.33	1 050 000	EUR	1 045 705	1 130 713	0,03
Iren SpA 0.25% 20 - 17.01.31	757 000	EUR	591 454	601 255	0,02
Iren SpA 0.875% 19 - 14.10.29	800 000	EUR	710 552	695 552	0,02
Iren SpA 1.00% 20 - 01.07.30	700 000	EUR	589 134	596 631	0,02
Iren SpA 1.50% 17 - 24.10.27	750 000	EUR	705 839	708 105	0,02
Iren SpA 1.95% 18 - 19.09.25	700 000	EUR	685 043	684 103	0,02
Italgas SpA Zero Coupon 21 - 16.02.28	800 000	EUR	704 128	707 592	0,02
Italgas SpA 0.25% 20 - 24.06.25	717 000	EUR	686 852	683 724	0,02
Italgas SpA 0.50% 21 - 16.02.33	700 000	EUR	543 882	533 722	0,01
Italgas SpA 0.875% 19 - 24.04.30	900 000	EUR	766 002	774 360	0,02
Italgas SpA 1.00% 19 - 11.12.31	800 000	EUR	664 249	664 744	0,02
Italgas SpA 1.625% 17 - 19.01.27	1 198 000	EUR	1 169 191	1 145 827	0,03
Italgas SpA 1.625% 17 - 18.01.29	800 000	EUR	772 208	748 720	0,02
Italgas SpA 4.125% 23 - 08.06.32	800 000	EUR	788 299	827 248	0,02
Leasys SpA 4.50% 23 - 26.07.26	1 400 000	EUR	1 403 743	1 424 934	0,04
Leasys SpA 4.625% 23 - 16.02.27	650 000	EUR	657 276	666 686	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.375% 20 - 08.01.26	500 000	EUR	484 210	487 310	0,01
Leonardo SpA 4.875% 05 - 24.03.25	1 000 000	EUR	1 008 889	1 013 240	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.75% 20 - 15.07.27	242 000	EUR	217 277	220 389	0,01
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 21 - 02.11.28	530 000	EUR	460 592	475 484	0,01
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.875% 19 - 15.01.26	724 000	EUR	689 987	688 814	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.00% 20 - 08.09.27	926 000	EUR	856 715	853 337	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 22 - 17.07.29	920 000	EUR	792 239	821 109	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.125% 19 - 15.07.25	645 000	EUR	626 053	620 838	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.125% 20 - 23.04.25	790 000	EUR	762 467	761 876	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.625% 19 - 07.01.25	750 000	EUR	736 328	732 818	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 01.02.30	610 000	EUR	608 234	628 263	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 22 - 07.02.29	710 000	EUR	707 488	738 968	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 14.03.28	1 390 000	EUR	1 396 166	1 436 454	0,04
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 13.09.27	840 000	EUR	841 896	863 579	0,02
Pirelli & C SpA 4.25% 23 - 18.01.28	902 000	EUR	906 631	936 646	0,02
Snam SpA Zero Coupon 20 - 07.12.28	714 000	EUR	618 303	612 326	0,02
Snam SpA Zero Coupon 21 - 15.08.25	731 000	EUR	691 589	693 375	0,02
Snam SpA 0.625% 21 - 30.06.31	800 000	EUR	681 938	656 328	0,02
Snam SpA 0.75% 20 - 17.06.30	1 099 000	EUR	976 616	933 062	0,02
Snam SpA 0.75% 22 - 20.06.29	1 399 000	EUR	1 224 128	1 220 614	0,03
Snam SpA 0.875% 16 - 25.10.26	1 600 000	EUR	1 515 613	1 507 488	0,04
Snam SpA 1.00% 19 - 12.09.34	821 000	EUR	665 606	635 397	0,02
Snam SpA 1.25% 19 - 28.08.25	846 000	EUR	825 659	818 488	0,02
Snam SpA 1.25% 22 - 20.06.34	940 000	EUR	761 852	760 545	0,02
Snam SpA 1.375% 17 - 25.10.27	728 000	EUR	711 319	686 213	0,02
Snam SpA 3.375% 22 - 05.12.26	600 000	EUR	592 020	604 596	0,02
Snam SpA 4.00% 23 - 27.11.29	1 060 000	EUR	1 066 146	1 091 694	0,03
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.125% 19 - 25.07.25	692 000	EUR	663 036	656 473	0,02
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.375% 20 - 25.09.30	810 000	EUR	681 847	670 299	0,02
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.375% 21 - 23.06.29	578 000	EUR	525 321	499 045	0,01
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.75% 20 - 24.07.32	800 000	EUR	640 163	652 112	0,02
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.00% 16 - 11.10.28	907 000	EUR	841 792	826 703	0,02
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.00% 19 - 10.04.26	900 000	EUR	857 029	858 555	0,02
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.375% 17 - 26.07.27	1 695 000	EUR	1 611 442	1 597 436	0,04
Terna - Rete Elettrica Nazionale 3.625% 23 - 21.04.29	1 300 000	EUR	1 282 299	1 326 832	0,03
Terna - Rete Elettrica Nazionale 3.875% 23 - 24.07.33	1 010 000	EUR	986 726	1 041 350	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.325% 21 - 19.01.26	1 527 000	EUR	1 447 270	1 437 838	0,04
UniCredit SpA 0.50% 19 - 09.04.25	1 310 000	EUR	1 270 790	1 258 805	0,03
UniCredit SpA FRN 21 - 05.07.29	1 400 000	EUR	1 253 319	1 244 768	0,03
UniCredit SpA 0.85% 21 - 19.01.31	1 700 000	EUR	1 368 839	1 401 582	0,04
UniCredit SpA FRN 22 - 18.01.28	1 996 000	EUR	1 835 242	1 853 366	0,05
UniCredit SpA FRN 20 - 20.01.26	1 751 000	EUR	1 690 644	1 699 556	0,04
UniCredit SpA FRN 20 - 16.06.26	2 025 000	EUR	1 959 267	1 954 591	0,05
UniCredit SpA 1.625% 22 - 18.01.32	729 000	EUR	598 023	623 208	0,02
UniCredit SpA 1.80% 20 - 20.01.30	1 230 000	EUR	1 075 515	1 103 900	0,03
UniCredit SpA 2.125% 16 - 24.10.26	1 500 000	EUR	1 453 857	1 461 690	0,04
UniCredit SpA FRN 20 - 22.07.27	1 882 000	EUR	1 806 371	1 818 068	0,05
UniCredit SpA FRN 23 - 16.02.29	1 642 000	EUR	1 595 027	1 679 832	0,04
UniCredit SpA FRN 23 - 14.02.30	800 000	EUR	812 465	835 000	0,02
UniCredit SpA FRN 23 - 17.01.29	1 500 000	EUR	1 510 343	1 569 930	0,04
UniCredit SpA FRN 22 - 15.11.27	1 430 000	EUR	1 459 546	1 514 985	0,04
			164 834 817	166 590 553	4,31
Japon					
Asahi Group Holdings Ltd. 0.336% 21 - 19.04.27	800 000	EUR	730 397	728 784	0,02
Asahi Group Holdings Ltd. 0.541% 20 - 23.10.28	1 212 000	EUR	1 070 557	1 069 929	0,03
Asahi Group Holdings Ltd. 1.151% 17 - 19.09.25	978 000	EUR	951 130	942 763	0,02
East Japan Railway Co. 0.773% 21 - 15.09.34	608 000	EUR	449 577	477 912	0,01
East Japan Railway Co. 1.104% 21 - 15.09.39	1 100 000	EUR	760 242	793 089	0,02
East Japan Railway Co. 1.85% 22 - 13.04.33	1 120 000	EUR	980 544	1 002 154	0,03
East Japan Railway Co. 2.614% 22 - 08.09.25	1 200 000	EUR	1 182 701	1 186 212	0,03
East Japan Railway Co. 3.245% 22 - 08.09.30	500 000	EUR	485 270	505 965	0,01
East Japan Railway Co. 3.976% 23 - 05.09.32	980 000	EUR	985 071	1 043 151	0,03
East Japan Railway Co. 4.11% 23 - 22.02.43	1 100 000	EUR	1 059 289	1 161 930	0,03
East Japan Railway Co. 4.389% 23 - 05.09.43	1 050 000	EUR	1 036 913	1 140 909	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 21 - 08.06.27	778 000	EUR	715 569	723 104	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.848% 19 - 19.07.29	662 000	EUR	599 522	593 185	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 3.556% 22 - 15.06.32	1 100 000	EUR	1 067 165	1 124 970	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 23 - 07.06.31	700 000	EUR	699 632	739 053	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 0.184% 21 - 13.04.26	1 400 000	EUR	1 311 110	1 305 696	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.214% 20 - 07.10.25	1 045 000	EUR	992 542	991 789	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.402% 19 - 06.09.29	600 000	EUR	507 518	505 032	0,01
Mizuho Financial Group Inc. FRN 21 - 06.09.29	1 416 000	EUR	1 254 434	1 222 928	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.693% 20 - 07.10.30	1 559 000	EUR	1 328 794	1 298 273	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.797% 20 - 15.04.30	1 143 000	EUR	1 001 825	969 527	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.843% 21 - 12.04.33	1 120 000	EUR	850 978	904 635	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 1.598% 18 - 10.04.28	817 000	EUR	760 970	767 384	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 1.631% 22 - 08.04.27	1 215 000	EUR	1 138 041	1 150 399	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 2.096% 22 - 08.04.32	1 115 000	EUR	970 943	999 887	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 3.49% 22 - 05.09.27	1 200 000	EUR	1 177 144	1 204 272	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 4.029% 22 - 05.09.32	700 000	EUR	685 319	721 350	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Mizuho Financial Group Inc. 4.157% 23 - 20.05.28	700 000	EUR	693 326	718 305	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 4.416% 23 - 20.05.33	1 101 000	EUR	1 087 687	1 158 230	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 4.608% 23 - 28.08.30	1 100 000	EUR	1 112 399	1 165 318	0,03
Nidec Corp. 0.046% 21 - 30.03.26	900 000	EUR	833 317	830 538	0,02
Nissan Motor Co. Ltd. 2.652% 20 - 17.03.26	1 100 000	EUR	1 050 235	1 073 699	0,03
Nissan Motor Co. Ltd. 3.201% 20 - 17.09.28	1 100 000	EUR	1 003 109	1 055 593	0,03
NTT Finance Corp. 0.01% 21 - 03.03.25	1 584 000	EUR	1 532 163	1 520 323	0,04
NTT Finance Corp. 0.082% 21 - 13.12.25	1 000 000	EUR	947 249	942 020	0,02
NTT Finance Corp. 0.342% 21 - 03.03.30	1 384 000	EUR	1 183 111	1 190 724	0,03
NTT Finance Corp. 0.399% 21 - 13.12.28	1 300 000	EUR	1 166 705	1 154 738	0,03
ORIX Corp. 1.919% 22 - 20.04.26	486 000	EUR	466 921	471 527	0,01
ORIX Corp. 4.477% 23 - 01.06.28	800 000	EUR	804 847	840 256	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.303% 20 - 28.10.27	539 000	EUR	473 767	484 114	0,01
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.632% 19 - 23.10.29	2 005 000	EUR	1 740 027	1 715 458	0,04
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.413% 17 - 14.06.27	920 000	EUR	873 576	863 788	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.546% 16 - 15.06.26	2 586 000	EUR	2 494 109	2 479 483	0,06
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 4.492% 23 - 12.06.30	700 000	EUR	705 642	738 073	0,02
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0.75% 20 - 09.07.27	1 000 000	EUR	951 419	926 150	0,02
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.00% 20 - 09.07.29	1 184 000	EUR	1 102 193	1 055 003	0,03
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.375% 20 - 09.07.32	1 562 000	EUR	1 356 102	1 336 478	0,04
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.00% 20 - 09.07.40	1 433 000	EUR	1 132 690	1 136 914	0,03
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.25% 18 - 21.11.26	2 296 000	EUR	2 259 574	2 243 238	0,06
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.00% 18 - 21.11.30	2 397 000	EUR	2 398 685	2 364 185	0,06
			52 122 050	52 738 437	1,36
Jersey					
Aptiv PLC 1.50% 15 - 10.03.25	900 000	EUR	879 418	876 411	0,02
Aptiv PLC 1.60% 16 - 15.09.28	900 000	EUR	808 970	838 935	0,02
Glencore Finance Europe Ltd. 1.50% 19 - 15.10.26	860 000	EUR	817 933	818 952	0,02
Glencore Finance Europe Ltd. 1.75% 15 - 17.03.25	1 100 000	EUR	1 083 160	1 074 997	0,03
Glencore Finance Europe Ltd. 3.75% 14 - 01.04.26	695 000	EUR	698 747	699 615	0,02
Heathrow Funding Ltd. 1.125% 21 - 08.10.30	725 000	EUR	619 146	620 194	0,02
Heathrow Funding Ltd. 1.50% 15 - 11.02.30	1 400 000	EUR	1 239 104	1 246 686	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.50% 20 - 12.10.25	1 200 000	EUR	1 157 962	1 162 380	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 17 - 12.07.32	700 000	EUR	596 856	612 374	0,01
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 19 - 14.03.34	1 000 000	EUR	852 158	842 520	0,02
Heathrow Funding Ltd. 4.50% 23 - 11.07.33	970 000	EUR	963 803	1 032 090	0,03
			9 717 257	9 825 154	0,25
Liechtenstein					
Swiss Life Finance I Ltd. 0.50% 21 - 15.09.31	810 000	EUR	640 335	656 845	0,02
Swiss Life Finance I Ltd. 3.25% 22 - 31.08.29	1 000 000	EUR	969 045	1 002 110	0,02
			1 609 380	1 658 955	0,04
Luxembourg					
Acef Holdings SCA 0.75% 21 - 14.06.28	603 000	EUR	509 419	518 689	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Acef Holdings SCA 1.25% 21 - 26.04.30	805 000	EUR	675 416	645 441	0,02
Alpha Trains Finance SA 2.064% 15 - 30.06.25	654 000	EUR	619 680	623 053	0,02
ArcelorMittal SA 1.75% 19 - 19.11.25	1 300 000	EUR	1 258 413	1 251 848	0,03
ArcelorMittal SA 4.875% 22 - 26.09.26	900 000	EUR	908 554	929 151	0,02
Aroundtown SA Zero Coupon 20 - 16.07.26	1 100 000	EUR	965 977	923 395	0,02
Aroundtown SA 0.375% 21 - 15.04.27	1 500 000	EUR	1 290 641	1 205 625	0,03
Aroundtown SA 0.625% 19 - 09.07.25	900 000	EUR	830 961	831 942	0,02
Aroundtown SA 1.00% 17 - 07.01.25	700 000	EUR	671 388	666 743	0,02
Aroundtown SA 1.45% 19 - 09.07.28	900 000	EUR	769 188	701 406	0,02
Aroundtown SA 1.50% 19 - 28.05.26	700 000	EUR	627 052	624 400	0,02
Aroundtown SA 1.625% 18 - 31.01.28	1 200 000	EUR	982 171	974 316	0,03
Aroundtown SA FRN 21 - 31.12.99	900 000	EUR	508 512	290 448	0,01
Aroundtown SA FRN 19 - 31.12.99	750 000	EUR	433 288	262 928	0,01
AXA Logistics Europe Master SCA 0.375% 21 - 15.11.26	626 000	EUR	563 603	568 809	0,01
AXA Logistics Europe Master SCA 0.875% 21 - 15.11.29	516 000	EUR	422 566	431 025	0,01
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 21 - 13.08.28	1 200 000	EUR	1 087 599	1 056 696	0,03
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 19 - 04.06.26	1 000 000	EUR	946 550	954 590	0,02
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.213% 21 - 12.02.36	771 000	EUR	570 566	596 500	0,02
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.336% 21 - 13.08.41	1 460 000	EUR	1 078 168	1 004 115	0,03
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 3.553% 23 - 13.09.29	1 213 000	EUR	1 186 771	1 238 243	0,03
Bevco Lux Sarl 1.00% 21 - 16.01.30	878 000	EUR	723 574	733 630	0,02
Bevco Lux Sarl 1.50% 20 - 16.09.27	798 000	EUR	733 632	749 091	0,02
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 1.00% 21 - 04.05.28	800 000	EUR	682 596	671 792	0,02
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 1.00% 21 - 20.10.26	1 000 000	EUR	889 916	897 060	0,02
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 1.25% 20 - 26.04.27	732 000	EUR	651 124	642 967	0,02
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 1.625% 21 - 20.04.30	805 000	EUR	630 316	644 258	0,02
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 1.75% 19 - 12.03.29	850 000	EUR	720 933	716 312	0,02
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 2.20% 18 - 24.07.25	900 000	EUR	860 968	861 498	0,02
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 3.625% 22 - 29.10.29	777 000	EUR	710 620	714 560	0,02
CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0.50% 21 - 27.01.28	705 000	EUR	592 175	622 882	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0.90% 21 - 12.10.29	805 000	EUR	658 857	668 802	0,02
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 0.75% 19 - 17.04.26	1 560 000	EUR	1 479 386	1 470 144	0,04
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1.125% 19 - 17.10.28	1 460 000	EUR	1 323 457	1 316 511	0,03
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1.50% 19 - 17.10.31	1 150 000	EUR	962 649	967 518	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA 1.625% 19 - 03.07.29	713 000	EUR	669 579	648 859	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 17 - 12.09.25	1 050 000	EUR	1 020 421	1 021 818	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 19 - 25.03.27	800 000	EUR	774 911	766 008	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA 1.875% 18 - 19.01.26	900 000	EUR	869 309	874 224	0,02
CPI Property Group SA 1.50% 21 - 27.01.31	1 187 000	EUR	806 396	618 107	0,02
CPI Property Group SA 1.625% 19 - 23.04.27	900 000	EUR	733 914	659 295	0,02
CPI Property Group SA 1.75% 22 - 14.01.30	1 140 000	EUR	849 873	649 811	0,02
CPI Property Group SA 2.75% 20 - 12.05.26	811 000	EUR	722 263	674 760	0,02
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl 2.125% 20 - 19.11.25	557 000	EUR	505 810	523 090	0,01
Czech Gas Networks Investments Sarl 0.45% 21 - 08.09.29	708 000	EUR	589 563	586 330	0,01
Czech Gas Networks Investments Sarl 0.875% 21 - 31.03.31	760 000	EUR	609 262	609 284	0,02
Czech Gas Networks Investments Sarl 1.00% 20 - 16.07.27	867 000	EUR	769 151	797 042	0,02
DH Europe Finance II Sarl 0.20% 19 - 18.03.26	1 810 000	EUR	1 714 120	1 699 137	0,04
DH Europe Finance II Sarl 0.45% 19 - 18.03.28	2 201 000	EUR	1 993 364	1 988 295	0,05
DH Europe Finance II Sarl 0.75% 19 - 18.09.31	2 644 000	EUR	2 325 590	2 228 495	0,06
DH Europe Finance II Sarl 1.35% 19 - 18.09.39	1 843 000	EUR	1 452 385	1 392 092	0,04
DH Europe Finance II Sarl 1.80% 19 - 18.09.49	1 150 000	EUR	793 675	835 624	0,02
DH Europe Finance Sarl 1.20% 17 - 30.06.27	1 021 000	EUR	965 472	963 947	0,02
Euroclear Investments SA 1.125% 16 - 07.12.26	800 000	EUR	759 724	762 248	0,02
Euroclear Investments SA FRN 21 - 16.06.51	500 000	EUR	387 041	394 385	0,01
Euroclear Investments SA 1.50% 18 - 11.04.30	600 000	EUR	561 910	549 744	0,01
Euroclear Investments SA FRN 18 - 11.04.48	500 000	EUR	467 962	463 320	0,01
Eurofins Scientific SE 0.875% 21 - 19.05.31	1 042 000	EUR	864 982	847 365	0,02
Eurofins Scientific SE 3.75% 20 - 17.07.26	539 000	EUR	540 721	545 188	0,01
Eurofins Scientific SE 4.00% 22 - 06.07.29	700 000	EUR	694 690	709 163	0,02
Eurofins Scientific SE 4.75% 23 - 06.09.30	1 030 000	EUR	1 029 854	1 084 786	0,03
GELF Bond Issuer I SA 1.125% 19 - 18.07.29	700 000	EUR	583 835	593 782	0,02
GELF Bond Issuer I SA 1.625% 16 - 20.10.26	300 000	EUR	290 966	285 189	0,01
Grand City Properties SA 0.125% 21 - 11.01.28	1 500 000	EUR	1 252 901	1 258 785	0,03
Grand City Properties SA 1.375% 17 - 03.08.26	900 000	EUR	823 047	829 368	0,02
Grand City Properties SA 1.50% 18 - 22.02.27	900 000	EUR	799 905	812 700	0,02
Grand City Properties SA FRN 20 - 31.12.99	1 100 000	EUR	720 249	495 220	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA 4.875% 23 - 21.11.33	1 000 000	EUR	1 025 159	1 065 360	0,03
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.125% 19 - 01.12.27	983 000	EUR	945 072	928 512	0,02
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.50% 17 - 14.06.27	800 000	EUR	769 265	767 640	0,02
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.625% 17 - 07.04.26	1 628 000	EUR	1 574 016	1 581 586	0,04
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.75% 18 - 24.04.28	1 265 000	EUR	1 198 576	1 206 494	0,03
Helvetia Europe SA FRN 20 - 30.09.41	949 000	EUR	807 428	822 356	0,02
Highland Holdings Sarl 0.318% 21 - 15.12.26	932 000	EUR	857 429	859 891	0,02
Highland Holdings Sarl 0.934% 21 - 15.12.31	626 000	EUR	541 595	517 408	0,01
Holcim Finance Luxembourg SA 0.125% 21 - 19.07.27	900 000	EUR	804 418	815 922	0,02
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 19 - 29.11.26	900 000	EUR	846 832	838 818	0,02
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 20 - 23.04.31	1 244 000	EUR	1 028 762	1 012 852	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 21 - 03.09.30	1 400 000	EUR	1 191 545	1 162 420	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 0.625% 21 - 19.01.33	1 100 000	EUR	867 745	858 902	0,02
Holcim Finance Luxembourg SA 0.625% 21 - 06.04.30	843 000	EUR	738 326	715 218	0,02
Holcim Finance Luxembourg SA 1.50% 22 - 06.04.25	677 000	EUR	660 839	659 432	0,02
Holcim Finance Luxembourg SA 1.75% 17 - 29.08.29	1 300 000	EUR	1 210 350	1 198 834	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 2.25% 16 - 26.05.28	1 400 000	EUR	1 378 840	1 357 020	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 2.375% 20 - 09.04.25	599 000	EUR	596 355	591 165	0,02
John Deere Bank SA 2.50% 22 - 14.09.26	1 000 000	EUR	978 214	988 940	0,03
John Deere Cash Management SARL 1.65% 19 - 13.06.39	900 000	EUR	689 080	726 759	0,02
John Deere Cash Management SARL 1.85% 20 - 02.04.28	855 000	EUR	817 573	825 973	0,02
John Deere Cash Management SARL 2.20% 20 - 02.04.32	949 000	EUR	906 506	895 865	0,02
Medtronic Global Holdings SCA Zero Coupon 20 - 15.10.25	1 600 000	EUR	1 517 695	1 512 240	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 0.25% 19 - 02.07.25	1 585 000	EUR	1 521 813	1 512 375	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 20 - 15.10.28	1 700 000	EUR	1 508 316	1 512 218	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 0.75% 20 - 15.10.32	1 300 000	EUR	1 073 161	1 071 018	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 19 - 02.07.31	1 400 000	EUR	1 188 617	1 210 188	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 19 - 07.03.27	2 271 000	EUR	2 174 093	2 146 663	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 1.375% 20 - 15.10.40	1 506 000	EUR	1 129 077	1 104 124	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 1.50% 19 - 02.07.39	1 700 000	EUR	1 313 693	1 296 352	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 1.625% 19 - 07.03.31	1 566 000	EUR	1 452 305	1 418 358	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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% 20 - 15.10.50	1 436 000	EUR	1 002 979	977 385	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 1.75% 19 - 02.07.49	1 500 000	EUR	1 105 605	1 053 735	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 2.25% 19 - 07.03.39	1 406 000	EUR	1 277 685	1 198 306	0,03
Medtronic Global Holdings SCA 2.625% 22 - 15.10.25	530 000	EUR	521 858	523 137	0,01
Medtronic Global Holdings SCA 3.00% 22 - 15.10.28	1 400 000	EUR	1 368 142	1 403 710	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 3.125% 22 - 15.10.31	1 590 000	EUR	1 529 707	1 595 485	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 3.375% 22 - 15.10.34	1 500 000	EUR	1 443 940	1 513 470	0,04
Mohawk Capital Finance SA 1.75% 20 - 12.06.27	800 000	EUR	742 903	756 336	0,02
Nestle Finance International Ltd. Zero Coupon 20 - 03.12.25	838 000	EUR	794 138	795 421	0,02
Nestle Finance International Ltd. Zero Coupon 20 - 03.03.33	1 029 000	EUR	774 362	795 890	0,02
Nestle Finance International Ltd. Zero Coupon 21 - 14.06.26	1 740 000	EUR	1 678 506	1 632 242	0,04
Nestle Finance International Ltd. 0.125% 20 - 12.11.27	1 200 000	EUR	1 122 900	1 093 572	0,03
Nestle Finance International Ltd. 0.25% 21 - 14.06.29	900 000	EUR	846 896	795 897	0,02
Nestle Finance International Ltd. 0.375% 20 - 12.05.32	1 510 000	EUR	1 239 137	1 246 263	0,03
Nestle Finance International Ltd. 0.375% 20 - 03.12.40	767 000	EUR	522 616	510 185	0,01
Nestle Finance International Ltd. 0.625% 21 - 14.02.34	660 000	EUR	545 173	533 128	0,01
Nestle Finance International Ltd. 0.875% 21 - 14.06.41	938 000	EUR	704 932	674 703	0,02
Nestle Finance International Ltd. 0.875% 22 - 29.03.27	974 000	EUR	918 359	922 846	0,02
Nestle Finance International Ltd. 1.125% 20 - 01.04.26	1 336 000	EUR	1 306 968	1 290 376	0,03
Nestle Finance International Ltd. 1.25% 17 - 02.11.29	1 079 000	EUR	1 022 877	997 233	0,03
Nestle Finance International Ltd. 1.25% 22 - 29.03.31	900 000	EUR	813 271	809 469	0,02
Nestle Finance International Ltd. 1.50% 20 - 01.04.30	1 586 000	EUR	1 491 197	1 474 282	0,04
Nestle Finance International Ltd. 1.50% 22 - 29.03.35	1 300 000	EUR	1 101 052	1 124 552	0,03
Nestle Finance International Ltd. 1.75% 17 - 02.11.37	1 100 000	EUR	975 535	950 334	0,02
Nestle Finance International Ltd. 3.00% 22 - 15.03.28	650 000	EUR	650 906	663 143	0,02
Nestle Finance International Ltd. 3.25% 22 - 15.01.31	800 000	EUR	801 136	823 288	0,02
Nestle Finance International Ltd. 3.375% 22 - 15.11.34	800 000	EUR	798 626	827 568	0,02
Nestle Finance International Ltd. 3.50% 23 - 13.12.27	1 500 000	EUR	1 512 839	1 549 125	0,04
Nestle Finance International Ltd. 3.50% 23 - 17.01.30	550 000	EUR	560 586	572 990	0,01
Nestle Finance International Ltd. 3.75% 23 - 13.03.33	1 020 000	EUR	1 037 824	1 094 776	0,03
Nestle Finance International Ltd. 3.75% 23 - 14.11.35	700 000	EUR	720 305	747 313	0,02
Novartis Finance SA Zero Coupon 20 - 23.09.28	2 946 000	EUR	2 654 494	2 606 385	0,07
Novartis Finance SA 0.625% 16 - 20.09.28	500 000	EUR	477 640	459 615	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Novartis Finance SA 1.125% 17 - 30.09.27	1 179 000	EUR	1 105 139	1 125 131	0,03
Novartis Finance SA 1.375% 18 - 14.08.30	1 305 000	EUR	1 191 027	1 199 034	0,03
Novartis Finance SA 1.625% 14 - 09.11.26	635 000	EUR	629 402	619 747	0,02
Novartis Finance SA 1.70% 18 - 14.08.38	1 009 000	EUR	846 171	867 790	0,02
Prologis International Funding II SA 0.75% 21 - 23.03.33	765 000	EUR	599 681	583 374	0,01
Prologis International Funding II SA 0.875% 19 - 09.07.29	579 000	EUR	514 139	508 107	0,01
Prologis International Funding II SA 1.625% 20 - 17.06.32	732 000	EUR	604 691	612 940	0,02
Prologis International Funding II SA 1.75% 18 - 15.03.28	690 000	EUR	655 309	648 966	0,02
Prologis International Funding II SA 1.876% 15 - 17.04.25	625 000	EUR	609 248	611 406	0,02
Prologis International Funding II SA 2.375% 18 - 14.11.30	425 000	EUR	381 434	391 026	0,01
Prologis International Funding II SA 3.125% 22 - 01.06.31	700 000	EUR	646 574	676 004	0,02
Prologis International Funding II SA 3.625% 22 - 07.03.30	800 000	EUR	753 214	793 848	0,02
Prologis International Funding II SA 4.625% 23 - 21.02.35	910 000	EUR	882 104	947 628	0,02
Repsol Europe Finance Sarl 0.375% 21 - 06.07.29	1 100 000	EUR	943 549	951 599	0,02
Repsol Europe Finance Sarl 0.875% 21 - 06.07.33	900 000	EUR	714 087	723 474	0,02
Richemont International Holdings SA 0.75% 20 - 26.05.28	1 000 000	EUR	919 902	917 730	0,02
Richemont International Holdings SA 1.00% 18 - 26.03.26	2 385 000	EUR	2 327 286	2 286 547	0,06
Richemont International Holdings SA 1.125% 20 - 26.05.32	1 231 000	EUR	1 086 259	1 066 563	0,03
Richemont International Holdings SA 1.50% 18 - 26.03.30	1 700 000	EUR	1 628 474	1 572 330	0,04
Richemont International Holdings SA 1.625% 20 - 26.05.40	900 000	EUR	709 049	718 605	0,02
Richemont International Holdings SA 2.00% 18 - 26.03.38	1 957 000	EUR	1 699 421	1 693 040	0,04
Segro Capital Sarl 0.50% 21 - 22.09.31	908 000	EUR	700 839	713 352	0,02
Segro Capital Sarl 1.25% 22 - 23.03.26	822 000	EUR	780 868	786 013	0,02
Segro Capital Sarl 1.875% 22 - 23.03.30	679 000	EUR	600 250	623 186	0,02
SELP Finance Sarl 0.875% 21 - 27.05.29	745 000	EUR	620 279	633 935	0,02
SELP Finance Sarl 1.50% 17 - 20.11.25	800 000	EUR	767 471	769 616	0,02
SELP Finance Sarl 1.50% 19 - 20.12.26	500 000	EUR	469 712	467 750	0,01
SELP Finance Sarl 3.75% 22 - 10.08.27	1 430 000	EUR	1 371 050	1 430 229	0,04
SES SA 0.875% 19 - 04.11.27	643 000	EUR	580 916	581 947	0,01
SES SA 1.625% 18 - 22.03.26	1 057 000	EUR	1 013 530	1 006 993	0,03
SES SA 2.00% 20 - 02.07.28	500 000	EUR	453 757	470 780	0,01
SES SA 3.50% 22 - 14.01.29	1 100 000	EUR	1 045 537	1 083 896	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Simon International Finance SCA 1.125% 21 - 19.03.33	1 040 000	EUR	831 493	840 226	0,02
Simon International Finance SCA 1.25% 16 - 13.05.25	899 000	EUR	871 028	867 544	0,02
SIX Finance Luxembourg SA Zero Coupon 20 - 02.12.25	1 400 000	EUR	1 313 403	1 315 608	0,03
Swiss Re Finance Luxembourg SA FRN 19 - 30.04.50	1 000 000	EUR	859 407	926 310	0,02
Traton Finance Luxembourg SA 0.125% 21 - 24.03.25	1 400 000	EUR	1 355 789	1 338 582	0,03
Traton Finance Luxembourg SA 0.75% 21 - 24.03.29	1 600 000	EUR	1 457 238	1 391 152	0,04
Traton Finance Luxembourg SA 1.25% 21 - 24.03.33	1 000 000	EUR	786 430	801 930	0,02
Traton Finance Luxembourg SA 4.00% 23 - 16.09.25	1 000 000	EUR	993 718	1 004 580	0,03
Traton Finance Luxembourg SA 4.125% 22 - 22.11.25	1 100 000	EUR	1 096 082	1 108 382	0,03
Traton Finance Luxembourg SA 4.125% 23 - 18.01.25	700 000	EUR	698 209	702 520	0,02
Traton Finance Luxembourg SA 4.25% 23 - 16.05.28	900 000	EUR	893 382	925 434	0,02
Traton Finance Luxembourg SA 4.50% 23 - 23.11.26	800 000	EUR	803 133	817 272	0,02
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 20 - 14.02.25	969 000	EUR	938 811	932 207	0,02
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 21 - 16.02.29	250 000	EUR	217 515	216 040	0,01
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 21 - 16.02.29	300 000	EUR	247 249	259 248	0,01
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 21 - 16.02.29	200 000	EUR	168 128	172 832	0,00
Whirlpool EMEA Finance Sarl 0.50% 20 - 20.02.28	840 000	EUR	740 025	744 240	0,02
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.10% 17 - 09.11.27	420 000	EUR	386 035	387 295	0,01
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.10% 17 - 09.11.27	280 000	EUR	260 579	258 196	0,01
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.25% 16 - 02.11.26	893 000	EUR	840 793	843 894	0,02
			167 456 136	166 272 990	4,30
Malte					
Bank of Valletta PLC FRN 22 - 06.12.27	418 000	EUR	436 547	454 567	0,01
			436 547	454 567	0,01
Mexique					
America Movil SAB de CV 0.75% 19 - 26.06.27	900 000	EUR	829 806	829 746	0,02
America Movil SAB de CV 2.125% 16 - 10.03.28	1 200 000	EUR	1 134 592	1 148 604	0,03
			1 964 398	1 978 350	0,05
Pays-Bas					
ABB Finance BV Zero Coupon 21 - 19.01.30	1 161 000	EUR	982 904	977 666	0,03
ABB Finance BV 3.25% 23 - 16.01.27	500 000	EUR	495 539	505 795	0,01
ABB Finance BV 3.375% 23 - 16.01.31	1 153 000	EUR	1 130 779	1 182 448	0,03
ABN AMRO Bank NV 0.50% 19 - 15.04.26	967 000	EUR	917 042	915 149	0,02
ABN AMRO Bank NV 0.50% 21 - 23.09.29	1 500 000	EUR	1 266 948	1 274 565	0,03
ABN AMRO Bank NV 0.60% 20 - 15.01.27	1 900 000	EUR	1 753 047	1 753 662	0,05
ABN AMRO Bank NV 0.875% 18 - 22.04.25	900 000	EUR	882 864	870 192	0,02
ABN AMRO Bank NV 1.00% 15 - 16.04.25	1 891 000	EUR	1 858 999	1 835 461	0,05
ABN AMRO Bank NV 1.00% 21 - 02.06.33	1 300 000	EUR	1 058 205	1 075 646	0,03
ABN AMRO Bank NV 1.25% 20 - 28.05.25	2 000 000	EUR	1 950 727	1 938 840	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
ABN AMRO Bank NV 1.25% 22 - 20.01.34	1 400 000	EUR	1 127 231	1 133 202	0,03
ABN AMRO Bank NV 2.375% 22 - 01.06.27	1 300 000	EUR	1 252 721	1 265 342	0,03
ABN AMRO Bank NV 3.00% 22 - 01.06.32	1 100 000	EUR	1 041 790	1 073 204	0,03
ABN AMRO Bank NV 3.625% 23 - 10.01.26	1 100 000	EUR	1 096 172	1 108 800	0,03
ABN AMRO Bank NV 3.75% 23 - 20.04.25	2 200 000	EUR	2 199 931	2 208 250	0,06
ABN AMRO Bank NV 3.875% 23 - 21.12.26	1 600 000	EUR	1 591 669	1 632 592	0,04
ABN AMRO Bank NV 4.00% 23 - 16.01.28	1 300 000	EUR	1 292 517	1 333 124	0,03
ABN AMRO Bank NV 4.25% 22 - 21.02.30	2 000 000	EUR	1 992 669	2 076 200	0,05
ABN AMRO Bank NV 4.375% 23 - 20.10.28	2 000 000	EUR	1 998 499	2 073 840	0,05
ABN AMRO Bank NV 4.50% 22 - 21.11.34	1 500 000	EUR	1 518 115	1 609 620	0,04
ABN AMRO Bank NV FRN 22 - 22.02.33	1 600 000	EUR	1 586 063	1 645 856	0,04
ABN AMRO Bank NV 5.50% 23 - 21.09.33	1 200 000	EUR	1 190 430	1 255 572	0,03
Achmea BV 1.50% 20 - 26.05.27	1 051 000	EUR	1 003 484	997 388	0,03
Achmea BV 3.625% 22 - 29.11.25	1 004 000	EUR	1 002 410	1 008 277	0,03
Achmea BV FRN 15 - 29.12.49	1 100 000	EUR	1 081 239	1 089 429	0,03
Achmea BV FRN 23 - 26.12.43	500 000	EUR	499 618	542 645	0,01
Adecco International Financial Services BV 0.125% 21 - 21.09.28	805 000	EUR	716 409	713 254	0,02
Adecco International Financial Services BV 0.50% 21 - 21.09.31	908 000	EUR	732 848	754 230	0,02
Adecco International Financial Services BV FRN 21 - 21.03.82	700 000	EUR	559 816	607 523	0,02
Adecco International Financial Services BV 1.25% 19 - 20.11.29	544 000	EUR	474 564	493 468	0,01
AGCO International Holdings BV 0.80% 21 - 06.10.28	900 000	EUR	777 198	788 166	0,02
Airbus SE 0.875% 16 - 13.05.26	900 000	EUR	860 651	863 730	0,02
Airbus SE 1.375% 16 - 13.05.31	1 350 000	EUR	1 231 071	1 209 816	0,03
Airbus SE 1.375% 20 - 09.06.26	1 110 000	EUR	1 078 069	1 068 408	0,03
Airbus SE 1.375% 20 - 09.06.26	200 000	EUR	194 251	192 506	0,00
Airbus SE 1.625% 20 - 07.04.25	500 000	EUR	492 148	489 860	0,01
Airbus SE 1.625% 20 - 07.04.25	200 000	EUR	195 437	195 944	0,01
Airbus SE 1.625% 20 - 09.06.30	1 880 000	EUR	1 736 483	1 737 064	0,04
Airbus SE 2.00% 20 - 07.04.28	1 000 000	EUR	968 713	966 080	0,02
Airbus SE 2.125% 14 - 29.10.29	716 000	EUR	687 212	688 176	0,02
Airbus SE 2.375% 20 - 07.04.32	1 500 000	EUR	1 481 164	1 428 780	0,04
Airbus SE 2.375% 20 - 09.06.40	1 506 000	EUR	1 258 118	1 289 784	0,03
Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 21 - 22.02.30	1 071 000	EUR	867 596	830 646	0,02
Akelius Residential Property Financing BV 1.00% 20 - 17.01.28	568 000	EUR	492 910	488 758	0,01
Akelius Residential Property Financing BV 1.125% 20 - 11.01.29	690 000	EUR	595 383	569 498	0,01
Akzo Nobel NV 1.125% 16 - 08.04.26	800 000	EUR	768 212	767 552	0,02
Akzo Nobel NV 1.50% 22 - 28.03.28	974 000	EUR	926 813	914 917	0,02
Akzo Nobel NV 1.625% 20 - 14.04.30	998 000	EUR	929 328	901 793	0,02
Akzo Nobel NV 2.00% 22 - 28.03.32	900 000	EUR	813 998	807 633	0,02
Akzo Nobel NV 4.00% 23 - 24.05.33	700 000	EUR	689 156	725 431	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Allianz Finance II BV Zero Coupon 20 - 14.01.25	200 000	EUR	200 215	193 298	0,00
Allianz Finance II BV Zero Coupon 20 - 14.01.25	400 000	EUR	387 106	386 596	0,01
Allianz Finance II BV Zero Coupon 21 - 22.11.26	1 000 000	EUR	926 289	927 900	0,02
Allianz Finance II BV 0.50% 20 - 14.01.31	1 100 000	EUR	961 889	948 827	0,02
Allianz Finance II BV 0.50% 21 - 22.11.33	800 000	EUR	625 315	643 016	0,02
Allianz Finance II BV 0.875% 17 - 06.12.27	900 000	EUR	864 542	844 605	0,02
Allianz Finance II BV 0.875% 19 - 15.01.26	1 300 000	EUR	1 255 490	1 249 547	0,03
Allianz Finance II BV 1.375% 16 - 21.04.31	1 100 000	EUR	1 005 374	1 008 051	0,03
Allianz Finance II BV 1.50% 19 - 15.01.30	1 000 000	EUR	962 563	933 770	0,02
Allianz Finance II BV 3.00% 13 - 13.03.28	1 100 000	EUR	1 144 574	1 117 831	0,03
Allianz Finance II BV 3.00% 13 - 13.03.28	200 000	EUR	200 271	203 242	0,01
American Medical Systems Europe BV 0.75% 22 - 08.03.25	1 457 000	EUR	1 416 072	1 408 526	0,04
American Medical Systems Europe BV 1.375% 22 - 08.03.28	1 118 000	EUR	1 052 043	1 046 359	0,03
American Medical Systems Europe BV 1.625% 22 - 08.03.31	1 118 000	EUR	1 002 577	1 010 281	0,03
American Medical Systems Europe BV 1.875% 22 - 08.03.34	679 000	EUR	572 372	590 676	0,02
Arcadis NV 4.875% 23 - 28.02.28	900 000	EUR	899 215	932 139	0,02
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 1.125% 18 - 17.09.25	800 000	EUR	777 919	771 624	0,02
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 2.00% 18 - 17.09.30	1 300 000	EUR	1 220 912	1 227 382	0,03
Argentum Netherlands BV for Swiss Life AG FRN 15 - 29.12.49	1 100 000	EUR	1 114 511	1 089 594	0,03
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co. Ltd. FRN 19 - 19.02.49	700 000	EUR	652 540	655 830	0,02
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co. Ltd. FRN 16 - 01.10.46	948 000	EUR	934 745	933 353	0,02
ASML Holding NV 3.50% 23 - 06.12.25	1 690 000	EUR	1 686 692	1 703 452	0,04
ASML Holdings NV 0.25% 20 - 25.02.30	1 100 000	EUR	956 803	944 526	0,02
ASML Holdings NV 0.625% 20 - 07.05.29	1 198 000	EUR	1 086 857	1 072 066	0,03
ASML Holdings NV 1.375% 16 - 07.07.26	1 308 000	EUR	1 284 434	1 260 990	0,03
ASML Holdings NV 1.625% 16 - 28.05.27	1 303 000	EUR	1 263 468	1 251 844	0,03
ASML Holdings NV 2.25% 22 - 17.05.32	700 000	EUR	656 820	676 893	0,02
ASR Nederland NV FRN 19 - 02.05.49	729 000	EUR	659 179	676 067	0,02
ASR Nederland NV 3.625% 23 - 12.12.28	900 000	EUR	911 972	913 248	0,02
ASR Nederland NV FRN 15 - 29.09.45	627 000	EUR	636 958	633 596	0,02
ASR Nederland NV FRN 22 - 07.12.43	1 500 000	EUR	1 560 267	1 690 500	0,04
Athora Netherlands NV FRN 21 - 15.07.31	286 000	EUR	248 036	254 714	0,01
Athora Netherlands NV FRN 22 - 31.08.32	900 000	EUR	857 935	862 785	0,02
BASF Finance Europe NV 0.75% 16 - 10.11.26	324 000	EUR	316 418	308 163	0,01
BAT Netherlands Finance BV 3.125% 20 - 07.04.28	1 111 000	EUR	1 117 398	1 108 389	0,03
BAT Netherlands Finance BV 5.375% 23 - 16.02.31	1 213 000	EUR	1 196 679	1 275 263	0,03
Bayer Capital Corp. BV 1.50% 18 - 26.06.26	2 900 000	EUR	2 818 034	2 763 149	0,07
Bayer Capital Corp. BV 2.125% 18 - 15.12.29	2 200 000	EUR	2 107 984	2 014 980	0,05
BMW Finance NV Zero Coupon 21 - 11.01.26	1 119 000	EUR	1 070 901	1 056 325	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.20% 21 - 11.01.33	600 000	EUR	451 659	472 602	0,01
BMW Finance NV 0.375% 19 - 24.09.27	1 100 000	EUR	1 014 333	1 014 057	0,03
BMW Finance NV 0.375% 20 - 14.01.27	1 149 000	EUR	1 098 862	1 072 201	0,03
BMW Finance NV 0.50% 22 - 22.02.25	1 756 000	EUR	1 716 769	1 697 174	0,04
BMW Finance NV 0.75% 19 - 13.07.26	1 200 000	EUR	1 158 532	1 137 132	0,03
BMW Finance NV 0.875% 17 - 03.04.25	1 050 000	EUR	1 035 122	1 018 731	0,03
BMW Finance NV 0.875% 20 - 14.01.32	940 000	EUR	804 099	818 890	0,02
BMW Finance NV 1.00% 15 - 21.01.25	1 100 000	EUR	1 088 654	1 071 026	0,03
BMW Finance NV 1.00% 18 - 29.08.25	1 300 000	EUR	1 265 484	1 256 567	0,03
BMW Finance NV 1.00% 22 - 22.05.28	866 000	EUR	813 061	803 172	0,02
BMW Finance NV 1.125% 18 - 10.01.28	1 238 000	EUR	1 155 683	1 159 288	0,03
BMW Finance NV 1.125% 18 - 22.05.26	1 136 000	EUR	1 104 350	1 089 026	0,03
BMW Finance NV 1.50% 19 - 06.02.29	2 347 000	EUR	2 250 997	2 194 867	0,06
BMW Finance NV 3.25% 23 - 22.11.26	1 300 000	EUR	1 290 288	1 311 271	0,03
BMW Finance NV 3.25% 23 - 22.07.30	700 000	EUR	688 268	715 617	0,02
BMW Finance NV 3.50% 23 - 06.04.25	800 000	EUR	799 410	801 536	0,02
BMW Finance NV 3.625% 23 - 22.05.35	1 100 000	EUR	1 095 578	1 143 967	0,03
BMW Finance NV 3.875% 23 - 04.10.28	900 000	EUR	898 065	941 058	0,02
BMW Finance NV 4.125% 23 - 04.10.33	840 000	EUR	832 627	904 621	0,02
BNI Finance BV 3.875% 23 - 01.12.30	1 070 000	EUR	1 071 344	1 109 611	0,03
BP Capital Markets BV 0.933% 20 - 04.12.40	1 143 000	EUR	748 073	756 232	0,02
BP Capital Markets BV 1.467% 21 - 21.09.41	1 100 000	EUR	775 773	778 327	0,02
BP Capital Markets BV 3.773% 23 - 12.05.30	1 120 000	EUR	1 113 184	1 157 990	0,03
BP Capital Markets BV 4.323% 23 - 12.05.35	1 090 000	EUR	1 084 712	1 155 891	0,03
Brenntag Finance BV 0.50% 21 - 06.10.29	800 000	EUR	674 090	684 736	0,02
Brenntag Finance BV 1.125% 17 - 27.09.25	962 000	EUR	925 779	926 570	0,02
CETIN Group NV 3.125% 22 - 14.04.27	800 000	EUR	755 681	774 160	0,02
Coca-Cola HBC Finance BV 0.625% 19 - 21.11.29	937 000	EUR	787 890	810 758	0,02
Coca-Cola HBC Finance BV 1.00% 19 - 14.05.27	766 000	EUR	733 863	717 719	0,02
Coca-Cola HBC Finance BV 1.625% 19 - 14.05.31	900 000	EUR	802 551	809 280	0,02
Coca-Cola HBC Finance BV 2.75% 22 - 23.09.25	800 000	EUR	788 311	792 592	0,02
Coloplast Finance BV 2.25% 22 - 19.05.27	1 310 000	EUR	1 266 205	1 271 290	0,03
Coloplast Finance BV 2.75% 22 - 19.05.30	1 067 000	EUR	1 013 735	1 031 992	0,03
Compass Group Finance Netherlands BV 1.50% 18 - 05.09.28	816 000	EUR	769 034	769 929	0,02
Compass Group Finance Netherlands BV 3.00% 22 - 08.03.30	600 000	EUR	573 038	597 198	0,02
Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 19 - 30.10.26	1 200 000	EUR	1 127 231	1 118 196	0,03
Cooperatieve Rabobank UA FRN 21 - 01.12.27	1 600 000	EUR	1 480 694	1 467 648	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 0.625% 21 - 25.02.33	1 300 000	EUR	1 001 483	1 035 723	0,03
Cooperatieve Rabobank UA FRN 20 - 05.05.28	1 300 000	EUR	1 215 250	1 198 301	0,03
Cooperatieve Rabobank UA 1.125% 19 - 07.05.31	1 500 000	EUR	1 295 400	1 288 350	0,03
Cooperatieve Rabobank UA 1.25% 16 - 23.03.26	3 023 000	EUR	2 940 148	2 914 232	0,08
Cooperatieve Rabobank UA 1.375% 15 - 03.02.27	2 100 000	EUR	2 045 346	1 996 680	0,05
Cooperatieve Rabobank UA FRN 22 - 30.11.32	1 200 000	EUR	1 157 261	1 199 748	0,03
Cooperatieve Rabobank UA 3.913% 23 - 03.11.26	1 800 000	EUR	1 804 196	1 840 734	0,05
Cooperatieve Rabobank UA 4.00% 23 - 10.01.30	2 000 000	EUR	1 997 134	2 065 100	0,05
Cooperatieve Rabobank UA 4.125% 10 - 14.07.25	4 051 000	EUR	4 174 752	4 097 586	0,11

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 FRN 23 - 25.04.29	1 700 000	EUR	1 695 185	1 749 470	0,05
Cooperatieve Rabobank UA FRN 22 - 27.01.28	1 500 000	EUR	1 516 515	1 553 190	0,04
CRH Funding BV 1.625% 20 - 05.05.30	1 286 000	EUR	1 184 882	1 171 636	0,03
CTP NV 0.50% 21 - 21.06.25	798 000	EUR	744 697	751 477	0,02
CTP NV 0.625% 21 - 27.09.26	708 000	EUR	630 827	636 924	0,02
CTP NV 0.75% 21 - 18.02.27	793 000	EUR	685 291	706 071	0,02
CTP NV 0.875% 22 - 20.01.26	1 040 000	EUR	949 226	964 309	0,02
CTP NV 1.25% 21 - 21.06.29	698 000	EUR	562 028	576 450	0,01
CTP NV 1.50% 21 - 27.09.31	808 000	EUR	598 217	628 584	0,02
CTP NV 2.125% 20 - 01.10.25	400 000	EUR	373 707	384 124	0,01
Daimler Truck International Finance BV 1.25% 22 - 06.04.25	1 100 000	EUR	1 067 211	1 069 497	0,03
Daimler Truck International Finance BV 1.625% 22 - 06.04.27	900 000	EUR	855 060	861 210	0,02
Daimler Truck International Finance BV 3.875% 23 - 19.06.26	1 100 000	EUR	1 095 843	1 118 546	0,03
Daimler Truck International Finance BV 3.875% 23 - 19.06.29	800 000	EUR	791 313	826 152	0,02
Danfoss Finance I BV 0.125% 21 - 28.04.26	852 000	EUR	811 625	791 414	0,02
Danfoss Finance I BV 0.375% 21 - 28.10.28	1 300 000	EUR	1 152 116	1 138 319	0,03
Danfoss Finance II BV 0.75% 21 - 28.04.31	580 000	EUR	470 781	481 191	0,01
Danfoss Finance II BV 4.125% 23 - 02.12.29	780 000	EUR	779 635	811 247	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 1.125% 17 - 22.05.26	998 000	EUR	958 774	963 110	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 17 - 30.01.27	1 502 000	EUR	1 444 335	1 444 098	0,04
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 18 - 01.12.25	1 381 000	EUR	1 351 586	1 343 202	0,03
Deutsche Telekom International Finance BV 1.50% 16 - 03.04.28	2 400 000	EUR	2 321 777	2 277 048	0,06
Deutsche Telekom International Finance BV 2.00% 18 - 01.12.29	1 400 000	EUR	1 379 730	1 354 990	0,04
Deutsche Telekom International Finance BV 3.25% 13 - 17.01.28	1 200 000	EUR	1 226 062	1 233 900	0,03
Deutsche Telekom International Finance BV 4.50% 10 - 28.10.30	500 000	EUR	533 870	550 495	0,01
Deutsche Telekom International Finance BV 4.875% 10 - 22.04.25	600 000	EUR	620 282	617 676	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 7.50% 03 - 24.01.33	800 000	EUR	1 086 896	1 074 416	0,03
Diageo Capital BV 0.125% 20 - 28.09.28	1 230 000	EUR	1 123 126	1 083 458	0,03
Diageo Capital BV 1.50% 22 - 08.06.29	1 015 000	EUR	938 080	944 914	0,02
Diageo Capital BV 1.875% 22 - 08.06.34	1 358 000	EUR	1 195 372	1 205 334	0,03
Digital Dutch Finco BV 0.625% 20 - 15.07.25	854 000	EUR	808 198	809 028	0,02
Digital Dutch Finco BV 1.00% 20 - 15.01.32	1 202 000	EUR	966 904	957 381	0,02
Digital Dutch Finco BV 1.25% 20 - 01.02.31	800 000	EUR	657 562	669 248	0,02
Digital Dutch Finco BV 1.50% 20 - 15.03.30	1 186 000	EUR	1 019 909	1 032 176	0,03
Digital Intrepid Holdings BV 0.625% 21 - 15.07.31	1 477 000	EUR	1 223 203	1 158 751	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Digital Intrepid Holdings BV 1.375% 22 - 18.07.32	1 100 000	EUR	878 420	895 488	0,02
DSM BV 0.25% 20 - 23.06.28	466 000	EUR	419 206	419 461	0,01
DSM BV 0.625% 20 - 23.06.32	735 000	EUR	618 639	606 926	0,02
DSM BV 0.75% 16 - 28.09.26	800 000	EUR	767 497	760 224	0,02
DSM BV 1.00% 15 - 09.04.25	892 000	EUR	866 497	866 962	0,02
DSV Finance BV 0.50% 21 - 03.03.31	799 000	EUR	660 317	668 084	0,02
DSV Finance BV 0.75% 21 - 05.07.33	710 000	EUR	561 733	566 552	0,01
DSV Finance BV 0.875% 21 - 17.09.36	708 000	EUR	503 169	524 904	0,01
DSV Finance BV 1.375% 22 - 16.03.30	1 100 000	EUR	984 370	995 390	0,03
E.ON International Finance BV 1.00% 17 - 13.04.25	1 095 000	EUR	1 066 325	1 061 822	0,03
E.ON International Finance BV 1.25% 17 - 19.10.27	1 256 000	EUR	1 223 912	1 180 941	0,03
E.ON International Finance BV 1.50% 18 - 31.07.29	1 498 000	EUR	1 421 676	1 392 840	0,04
E.ON International Finance BV 1.625% 18 - 30.05.26	899 000	EUR	870 792	873 379	0,02
E.ON International Finance BV 5.75% 03 - 14.02.33	800 000	EUR	999 004	952 936	0,02
easyJet FinCo BV 1.875% 21 - 03.03.28	1 841 000	EUR	1 673 327	1 720 746	0,04
EDP Finance BV 0.375% 19 - 16.09.26	645 000	EUR	618 688	600 959	0,02
EDP Finance BV 1.50% 17 - 22.11.27	600 000	EUR	577 018	566 766	0,01
EDP Finance BV 1.625% 18 - 26.01.26	1 400 000	EUR	1 367 170	1 353 996	0,03
EDP Finance BV 1.875% 18 - 13.10.25	1 000 000	EUR	978 600	977 340	0,03
EDP Finance BV 1.875% 22 - 21.09.29	1 700 000	EUR	1 568 329	1 587 545	0,04
EDP Finance BV 2.00% 15 - 22.04.25	1 100 000	EUR	1 086 097	1 079 826	0,03
EDP Finance BV 3.875% 22 - 11.03.30	600 000	EUR	597 198	620 682	0,02
ELM BV for Firmenich International SA FRN 20 - 31.12.99	1 000 000	EUR	959 024	978 610	0,03
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG FRN 17 - 29.09.47	800 000	EUR	754 297	763 232	0,02
ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group FRN 16 - 29.12.49	971 000	EUR	970 415	961 542	0,02
ELM BV for Swiss Reinsurance Co. Ltd. FRN 15 - 29.12.49	950 000	EUR	913 039	917 520	0,02
Enel Finance International NV Zero Coupon 21 - 17.06.27	1 197 000	EUR	1 112 769	1 078 557	0,03
Enel Finance International NV Zero Coupon 21 - 28.05.26	1 770 000	EUR	1 667 071	1 641 958	0,04
Enel Finance International NV 0.25% 22 - 17.11.25	2 100 000	EUR	2 010 293	1 987 650	0,05
Enel Finance International NV 0.375% 19 - 17.06.27	1 500 000	EUR	1 374 783	1 366 740	0,04
Enel Finance International NV 0.375% 21 - 28.05.29	1 600 000	EUR	1 372 710	1 377 424	0,04
Enel Finance International NV 0.50% 21 - 17.06.30	1 696 000	EUR	1 486 364	1 420 349	0,04
Enel Finance International NV 0.875% 21 - 17.06.36	1 497 000	EUR	1 063 622	1 068 978	0,03
Enel Finance International NV 0.875% 21 - 28.09.34	1 870 000	EUR	1 457 611	1 407 325	0,04
Enel Finance International NV 0.875% 22 - 17.01.31	1 193 000	EUR	1 014 886	1 006 403	0,03
Enel Finance International NV 1.125% 18 - 16.09.26	2 000 000	EUR	1 916 477	1 901 580	0,05
Enel Finance International NV 1.125% 19 - 17.10.34	606 000	EUR	469 202	468 493	0,01
Enel Finance International NV 1.25% 22 - 17.01.35	1 193 000	EUR	948 685	935 920	0,02
Enel Finance International NV 1.375% 16 - 01.06.26	1 500 000	EUR	1 451 134	1 436 610	0,04
Enel Finance International NV 1.50% 19 - 21.07.25	1 520 000	EUR	1 489 165	1 476 528	0,04
Enel Finance International NV 1.966% 15 - 27.01.25	1 385 000	EUR	1 373 485	1 360 153	0,04
Enel Finance International NV 3.875% 22 - 09.03.29	1 360 000	EUR	1 351 463	1 404 894	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Enel Finance International NV 4.00% 23 - 20.02.31	900 000	EUR	882 941	930 438	0,02
Enel Finance International NV 4.50% 23 - 20.02.43	1 200 000	EUR	1 128 433	1 237 764	0,03
Essity Capital BV 0.25% 21 - 15.09.29	800 000	EUR	710 795	695 704	0,02
Essity Capital BV 3.00% 22 - 21.09.26	670 000	EUR	662 555	668 178	0,02
Euronext NV 0.125% 21 - 17.05.26	1 174 000	EUR	1 094 777	1 091 632	0,03
Euronext NV 0.75% 21 - 17.05.31	900 000	EUR	757 084	750 330	0,02
Euronext NV 1.00% 18 - 18.04.25	510 000	EUR	499 216	492 782	0,01
Euronext NV 1.125% 19 - 12.06.29	1 300 000	EUR	1 194 964	1 186 991	0,03
Euronext NV 1.50% 21 - 17.05.41	880 000	EUR	648 048	661 038	0,02
EXOR NV 0.875% 21 - 19.01.31	800 000	EUR	674 327	689 088	0,02
EXOR NV 1.75% 18 - 18.01.28	500 000	EUR	472 264	478 475	0,01
EXOR NV 1.75% 19 - 14.10.34	767 000	EUR	640 380	642 048	0,02
EXOR NV 2.25% 20 - 29.04.30	800 000	EUR	737 763	753 864	0,02
Ferrovial SE 4.375% 23 - 13.09.30	880 000	EUR	873 900	928 180	0,02
Givaudan Finance Europe BV 1.00% 20 - 22.04.27	557 000	EUR	531 559	528 420	0,01
Givaudan Finance Europe BV 1.625% 20 - 22.04.32	700 000	EUR	607 327	625 394	0,02
Givaudan Finance Europe BV 4.125% 23 - 28.11.33	680 000	EUR	688 059	724 642	0,02
Global Switch Finance BV 1.375% 20 - 07.10.30	1 008 000	EUR	904 157	910 748	0,02
GSK Capital BV 3.00% 22 - 28.11.27	1 004 000	EUR	996 407	1 012 052	0,03
GSK Capital BV 3.125% 22 - 28.11.32	1 266 000	EUR	1 225 570	1 280 445	0,03
H&M Finance BV 0.25% 21 - 25.08.29	793 000	EUR	654 248	662 583	0,02
H&M Finance BV 4.875% 23 - 25.10.31	730 000	EUR	733 887	779 881	0,02
Haleon Netherlands Capital BV 1.25% 22 - 29.03.26	1 114 000	EUR	1 067 732	1 068 716	0,03
Haleon Netherlands Capital BV 1.75% 22 - 29.03.30	1 118 000	EUR	1 044 335	1 030 136	0,03
Haleon Netherlands Capital BV 2.125% 22 - 29.03.34	1 200 000	EUR	1 048 817	1 065 276	0,03
Heimstaden Bostad Treasury BV 0.625% 22 - 24.07.25	1 140 000	EUR	1 050 661	1 010 519	0,03
Heimstaden Bostad Treasury BV 0.75% 21 - 06.09.29	1 100 000	EUR	848 433	721 578	0,02
Heimstaden Bostad Treasury BV 1.00% 21 - 13.04.28	1 158 000	EUR	947 133	829 244	0,02
Heimstaden Bostad Treasury BV 1.375% 20 - 03.03.27	1 200 000	EUR	1 027 902	950 808	0,02
Heimstaden Bostad Treasury BV 1.375% 22 - 24.07.28	729 000	EUR	567 304	522 270	0,01
Heimstaden Bostad Treasury BV 1.625% 21 - 13.10.31	1 058 000	EUR	826 393	665 493	0,02
Heineken NV 1.00% 16 - 04.05.26	1 700 000	EUR	1 644 195	1 621 613	0,04
Heineken NV 1.25% 18 - 17.03.27	800 000	EUR	762 305	756 504	0,02
Heineken NV 1.25% 20 - 07.05.33	852 000	EUR	755 239	722 070	0,02
Heineken NV 1.375% 16 - 29.01.27	1 115 000	EUR	1 045 356	1 062 149	0,03
Heineken NV 1.50% 17 - 03.10.29	1 132 000	EUR	1 077 411	1 045 696	0,03
Heineken NV 1.625% 20 - 30.03.25	855 000	EUR	842 073	836 917	0,02
Heineken NV 1.75% 18 - 17.03.31	1 170 000	EUR	1 097 072	1 072 878	0,03
Heineken NV 1.75% 20 - 07.05.40	1 280 000	EUR	1 014 682	1 029 440	0,03
Heineken NV 2.25% 20 - 30.03.30	1 018 000	EUR	994 941	975 977	0,03
Heineken NV 2.875% 12 - 04.08.25	1 198 000	EUR	1 201 642	1 191 627	0,03
Heineken NV 3.625% 23 - 15.11.26	800 000	EUR	805 099	812 656	0,02
Heineken NV 3.875% 23 - 23.09.30	1 200 000	EUR	1 209 793	1 256 388	0,03
Heineken NV 4.125% 23 - 23.03.35	1 090 000	EUR	1 102 281	1 168 545	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Iberdrola International BV 0.375% 16 - 15.09.25	1 200 000	EUR	1 154 354	1 146 864	0,03
Iberdrola International BV 1.125% 16 - 21.04.26	1 300 000	EUR	1 279 205	1 253 005	0,03
Iberdrola International BV FRN 21 - 31.12.99	1 400 000	EUR	1 269 373	1 274 364	0,03
Iberdrola International BV FRN 21 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 223 882	1 277 115	0,03
Iberdrola International BV FRN 20 - 31.12.99	2 400 000	EUR	2 241 794	2 258 760	0,06
Iberdrola International BV FRN 20 - 31.12.99	2 100 000	EUR	1 838 245	1 874 313	0,05
Iberdrola International BV FRN 19 - 31.12.99	1 100 000	EUR	1 091 565	1 085 953	0,03
IMCD NV 2.125% 22 - 31.03.27	300 000	EUR	275 809	286 692	0,01
IMCD NV 4.875% 23 - 18.09.28	1 000 000	EUR	990 360	1 048 170	0,03
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1.75% 21 - 18.03.33	1 590 000	EUR	1 213 912	1 242 092	0,03
Imperial Brands Finance Netherlands BV 5.25% 23 - 15.02.31	1 390 000	EUR	1 364 169	1 438 664	0,04
ING Bank NV 4.125% 23 - 02.10.26	1 500 000	EUR	1 503 385	1 536 690	0,04
ING Groep NV FRN 20 - 18.02.29	1 900 000	EUR	1 682 274	1 648 706	0,04
ING Groep NV FRN 21 - 01.02.30	2 400 000	EUR	2 073 521	2 023 896	0,05
ING Groep NV FRN 21 - 29.09.28	2 100 000	EUR	1 917 000	1 864 107	0,05
ING Groep NV FRN 21 - 09.06.32	800 000	EUR	702 388	718 488	0,02
ING Groep NV FRN 21 - 29.11.30	1 300 000	EUR	1 126 664	1 110 096	0,03
ING Groep NV FRN 19 - 13.11.30	1 600 000	EUR	1 473 683	1 498 960	0,04
ING Groep NV FRN 21 - 16.11.32	1 600 000	EUR	1 395 350	1 414 864	0,04
ING Groep NV 1.125% 18 - 14.02.25	1 400 000	EUR	1 375 831	1 363 376	0,04
ING Groep NV FRN 22 - 16.02.27	2 300 000	EUR	2 196 148	2 187 461	0,06
ING Groep NV 1.375% 17 - 11.01.28	1 400 000	EUR	1 353 477	1 317 050	0,03
ING Groep NV FRN 22 - 16.02.31	2 100 000	EUR	1 909 101	1 876 938	0,05
ING Groep NV FRN 18 - 22.03.30	1 100 000	EUR	1 063 807	1 063 755	0,03
ING Groep NV 2.00% 18 - 20.09.28	2 400 000	EUR	2 260 088	2 281 344	0,06
ING Groep NV 2.125% 19 - 10.01.26	1 600 000	EUR	1 568 093	1 567 152	0,04
ING Groep NV FRN 20 - 26.05.31	2 300 000	EUR	2 189 693	2 194 154	0,06
ING Groep NV FRN 22 - 23.05.26	2 100 000	EUR	2 052 426	2 054 598	0,05
ING Groep NV 2.50% 18 - 15.11.30	2 000 000	EUR	1 959 247	1 914 780	0,05
ING Groep NV FRN 22 - 24.08.33	1 400 000	EUR	1 334 242	1 404 690	0,04
ING Groep NV FRN 23 - 23.05.29	2 200 000	EUR	2 198 111	2 267 386	0,06
ING Groep NV FRN 23 - 23.05.34	2 200 000	EUR	2 217 960	2 340 558	0,06
ING Groep NV FRN 22 - 14.11.27	1 900 000	EUR	1 931 093	1 970 566	0,05
ING Groep NV FRN 23 - 20.02.35	900 000	EUR	870 540	928 683	0,02
ING Groep NV FRN 22 - 14.11.33	1 400 000	EUR	1 463 602	1 536 934	0,04
ISS Finance BV 1.25% 20 - 07.07.25	722 000	EUR	700 607	694 665	0,02
JAB Holdings BV 1.00% 19 - 20.12.27	900 000	EUR	842 126	826 767	0,02
JAB Holdings BV 1.00% 21 - 14.07.31	400 000	EUR	319 650	338 980	0,01
JAB Holdings BV 1.625% 15 - 30.04.25	900 000	EUR	879 963	877 941	0,02
JAB Holdings BV 1.75% 18 - 25.06.26	1 500 000	EUR	1 462 607	1 446 240	0,04
JAB Holdings BV 2.00% 17 - 18.05.28	900 000	EUR	858 429	856 215	0,02
JAB Holdings BV 2.25% 19 - 19.12.39	1 100 000	EUR	884 965	856 284	0,02
JAB Holdings BV 2.50% 18 - 25.06.29	1 300 000	EUR	1 220 214	1 249 612	0,03
JAB Holdings BV 2.50% 20 - 17.04.27	1 000 000	EUR	975 035	977 370	0,03
JAB Holdings BV 3.375% 20 - 17.04.35	700 000	EUR	638 943	666 673	0,02
JAB Holdings BV 4.75% 22 - 29.06.32	800 000	EUR	802 539	851 344	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
JAB Holdings BV 5.00% 23 - 12.06.33	700 000	EUR	705 757	754 600	0,02
JDE Peet's NV Zero Coupon 21 - 16.01.26	936 000	EUR	894 275	874 935	0,02
JDE Peet's NV 0.244% 21 - 16.01.25	626 000	EUR	609 251	602 569	0,02
JDE Peet's NV 0.50% 21 - 16.01.29	1 030 000	EUR	907 876	892 279	0,02
JDE Peet's NV 0.625% 21 - 09.02.28	1 032 000	EUR	914 601	924 662	0,02
JDE Peet's NV 1.125% 21 - 16.06.33	900 000	EUR	686 309	720 927	0,02
JDE Peet's NV 4.125% 23 - 23.01.30	870 000	EUR	877 205	893 960	0,02
JDE Peet's NV 4.50% 23 - 23.01.34	750 000	EUR	756 271	787 808	0,02
JT International Financial Services BV 1.00% 19 - 26.11.29	500 000	EUR	454 915	443 310	0,01
JT International Financial Services BV 1.125% 18 - 28.09.25	1 000 000	EUR	959 045	957 170	0,02
JT International Financial Services BV FRN 20 - 07.04.81	645 000	EUR	613 020	615 382	0,02
JT International Financial Services BV FRN 20 - 07.10.83	845 000	EUR	745 548	774 181	0,02
Koninklijke Ahold Delhaize NV 0.25% 19 - 26.06.25	800 000	EUR	767 606	767 736	0,02
Koninklijke Ahold Delhaize NV 0.375% 21 - 18.03.30	800 000	EUR	695 292	677 360	0,02
Koninklijke Ahold Delhaize NV 1.125% 18 - 19.03.26	699 000	EUR	685 939	673 487	0,02
Koninklijke Ahold Delhaize NV 1.75% 20 - 02.04.27	929 000	EUR	899 048	897 609	0,02
Koninklijke Ahold Delhaize NV 3.50% 23 - 04.04.28	900 000	EUR	897 517	918 693	0,02
Koninklijke KPN NV 0.625% 16 - 09.04.25	800 000	EUR	778 108	771 424	0,02
Koninklijke KPN NV 0.875% 20 - 14.12.32	1 200 000	EUR	970 008	977 676	0,03
Koninklijke KPN NV 0.875% 21 - 15.11.33	900 000	EUR	713 371	717 300	0,02
Koninklijke KPN NV 1.125% 16 - 11.09.28	1 100 000	EUR	994 633	1 015 102	0,03
Koninklijke KPN NV 3.875% 23 - 03.07.31	800 000	EUR	790 369	829 512	0,02
Koninklijke Philips NV 0.50% 19 - 22.05.26	1 401 000	EUR	1 329 324	1 306 208	0,03
Koninklijke Philips NV 1.375% 18 - 02.05.28	400 000	EUR	376 067	369 496	0,01
Koninklijke Philips NV 1.375% 20 - 30.03.25	700 000	EUR	677 220	682 024	0,02
Koninklijke Philips NV 1.875% 22 - 05.05.27	900 000	EUR	868 806	858 978	0,02
Koninklijke Philips NV 2.00% 20 - 30.03.30	800 000	EUR	748 522	727 448	0,02
Koninklijke Philips NV 2.125% 22 - 05.11.29	1 100 000	EUR	1 032 402	1 011 538	0,03
Koninklijke Philips NV 2.625% 22 - 05.05.33	900 000	EUR	806 909	807 237	0,02
Koninklijke Philips NV 4.25% 23 - 08.09.31	700 000	EUR	693 538	716 779	0,02
LeasePlan Corp. NV 0.25% 21 - 23.02.26	1 385 000	EUR	1 296 225	1 290 501	0,03
LeasePlan Corp. NV 0.25% 21 - 07.09.26	1 460 000	EUR	1 350 656	1 341 185	0,03
LeasePlan Corp. NV 2.125% 22 - 06.05.25	1 114 000	EUR	1 088 095	1 093 970	0,03
LeasePlan Corp. NV 3.50% 20 - 09.04.25	874 000	EUR	873 922	873 327	0,02
Linde Finance BV 0.25% 20 - 19.05.27	1 300 000	EUR	1 200 376	1 193 907	0,03
Linde Finance BV 0.55% 20 - 19.05.32	1 300 000	EUR	1 094 057	1 076 660	0,03
Linde Finance BV 1.00% 16 - 20.04.28	858 000	EUR	816 434	807 258	0,02
Louis Dreyfus Co. Finance BV 1.625% 21 - 28.04.28	605 000	EUR	544 257	561 888	0,01
Louis Dreyfus Co. Finance BV 2.375% 20 - 27.11.25	1 157 000	EUR	1 128 936	1 129 845	0,03
Lseg Netherlands BV Zero Coupon 21 - 06.04.25	720 000	EUR	691 015	690 134	0,02
Lseg Netherlands BV 0.25% 21 - 06.04.28	490 000	EUR	471 365	436 820	0,01
Lseg Netherlands BV 0.75% 21 - 06.04.33	810 000	EUR	663 498	651 232	0,02
Lseg Netherlands BV 4.125% 23 - 29.09.26	1 120 000	EUR	1 123 125	1 148 851	0,03
Lseg Netherlands BV 4.231% 23 - 29.09.30	1 010 000	EUR	1 012 086	1 066 166	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
LYB International Finance II BV 0.875% 19 - 17.09.26	500 000	EUR	469 771	468 415	0,01
LYB International Finance II BV 1.625% 19 - 17.09.31	883 000	EUR	790 325	767 150	0,02
Madrilena Red de Gas Finance BV 1.375% 17 - 11.04.25	305 000	EUR	296 935	294 069	0,01
Madrilena Red de Gas Finance BV 2.25% 17 - 11.04.29	474 000	EUR	416 805	423 780	0,01
Mercedes-Benz International Finance BV 0.375% 19 - 08.11.26	1 545 000	EUR	1 482 162	1 442 458	0,04
Mercedes-Benz International Finance BV 0.625% 19 - 06.05.27	2 057 000	EUR	1 928 620	1 915 088	0,05
Mercedes-Benz International Finance BV 0.85% 17 - 28.02.25	1 848 000	EUR	1 817 395	1 795 184	0,05
Mercedes-Benz International Finance BV 1.00% 18 - 11.11.25	1 797 000	EUR	1 762 716	1 724 689	0,04
Mercedes-Benz International Finance BV 1.00% 18 - 11.11.25	100 000	EUR	95 563	95 976	0,00
Mercedes-Benz International Finance BV 1.375% 19 - 26.06.26	1 398 000	EUR	1 362 208	1 342 877	0,03
Mercedes-Benz International Finance BV 1.50% 16 - 09.03.26	1 600 000	EUR	1 576 837	1 546 992	0,04
Mercedes-Benz International Finance BV 1.50% 18 - 09.02.27	407 000	EUR	387 018	391 103	0,01
Mercedes-Benz International Finance BV 1.50% 18 - 09.02.27	300 000	EUR	285 159	288 282	0,01
Mercedes-Benz International Finance BV 2.00% 20 - 22.08.26	1 632 000	EUR	1 611 763	1 598 054	0,04
Mercedes-Benz International Finance BV 2.625% 20 - 07.04.25	2 111 000	EUR	2 112 084	2 090 924	0,05
Mercedes-Benz International Finance BV 3.40% 23 - 13.04.25	900 000	EUR	896 895	899 127	0,02
Mercedes-Benz International Finance BV 3.50% 23 - 30.05.26	1 630 000	EUR	1 628 043	1 647 327	0,04
Mercedes-Benz International Finance BV 3.70% 23 - 30.05.31	1 520 000	EUR	1 531 485	1 588 734	0,04
Mondelez International Holdings Netherlands BV Zero Coupon 20 - 22.09.26	568 000	EUR	521 775	525 570	0,01
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.25% 21 - 09.09.29	861 000	EUR	751 167	741 640	0,02
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.375% 20 - 22.09.29	1 108 000	EUR	963 774	955 960	0,02
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.625% 21 - 09.09.32	1 061 000	EUR	884 500	856 439	0,02
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.875% 19 - 01.10.31	800 000	EUR	671 541	678 200	0,02
Mondelez International Holdings Netherlands BV 1.25% 21 - 09.09.41	1 011 000	EUR	760 321	716 000	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.375% 19 - 26.02.25	800 000	EUR	777 799	770 744	0,02
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.50% 21 - 21.09.28	900 000	EUR	777 064	793 890	0,02
Naturgy Finance BV 0.75% 19 - 28.11.29	1 300 000	EUR	1 186 193	1 144 988	0,03
Naturgy Finance BV 0.875% 17 - 15.05.25	1 000 000	EUR	983 602	964 080	0,02
Naturgy Finance BV 1.25% 16 - 19.04.26	700 000	EUR	681 259	670 586	0,02
Naturgy Finance BV 1.25% 20 - 15.01.26	1 800 000	EUR	1 736 924	1 725 462	0,04
Naturgy Finance BV 1.375% 15 - 21.01.25	500 000	EUR	492 080	488 310	0,01
Naturgy Finance BV 1.375% 17 - 19.01.27	1 600 000	EUR	1 542 460	1 516 768	0,04
Naturgy Finance BV 1.50% 18 - 29.01.28	1 200 000	EUR	1 141 864	1 129 068	0,03
Naturgy Finance BV 1.875% 17 - 05.10.29	400 000	EUR	370 196	371 696	0,01
NE Property BV 1.875% 19 - 09.10.26	650 000	EUR	593 187	593 769	0,02
NE Property BV 2.00% 22 - 20.01.30	929 000	EUR	726 400	748 365	0,02
NE Property BV 3.375% 20 - 14.07.27	573 000	EUR	538 672	539 732	0,01
NIBC Bank NV 0.25% 21 - 09.09.26	1 100 000	EUR	991 631	1 005 983	0,03
NIBC Bank NV 0.875% 19 - 08.07.25	700 000	EUR	668 316	669 382	0,02
NIBC Bank NV 0.875% 22 - 24.06.27	600 000	EUR	530 673	546 462	0,01
NIBC Bank NV 6.00% 23 - 16.11.28	700 000	EUR	722 938	743 848	0,02
NIBC Bank NV 6.375% 23 - 01.12.25	800 000	EUR	801 081	838 056	0,02
NN Group NV 0.875% 21 - 23.11.31	900 000	EUR	741 726	771 615	0,02
NN Group NV 1.625% 17 - 01.06.27	700 000	EUR	659 334	673 351	0,02
NN Group NV FRN 14 - 15.07.49	1 500 000	EUR	1 528 439	1 494 075	0,04
NN Group NV FRN 17 - 13.01.48	1 300 000	EUR	1 312 071	1 302 730	0,03
NN Group NV FRN 22 - 01.03.43	700 000	EUR	664 511	714 924	0,02
NN Group NV FRN 23 - 03.11.43	1 560 000	EUR	1 549 721	1 662 835	0,04
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.125% 21 - 04.06.28	1 100 000	EUR	1 010 287	987 723	0,03
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.75% 22 - 31.03.25	779 000	EUR	761 769	755 248	0,02
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 1.125% 22 - 30.09.27	579 000	EUR	549 932	548 724	0,01
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 1.375% 22 - 31.03.30	700 000	EUR	644 689	650 608	0,02
OCI NV 3.625% 20 - 15.10.25	180 000	EUR	178 827	178 240	0,00
PACCAR Financial Europe BV Zero Coupon 21 - 01.03.26	715 000	EUR	667 354	668 132	0,02
PACCAR Financial Europe BV 3.25% 22 - 29.11.25	700 000	EUR	694 299	700 952	0,02
PACCAR Financial Europe BV 3.375% 23 - 15.05.26	760 000	EUR	756 234	767 402	0,02
PostNL NV 0.625% 19 - 23.09.26	630 000	EUR	581 279	583 267	0,02
Prosus NV Zero Coupon 21 - 13.07.29	1 370 000	EUR	1 177 233	1 113 015	0,03
Prosus NV 1.207% 22 - 19.01.26	720 000	EUR	663 026	676 706	0,02
Prosus NV 1.539% 20 - 03.08.28	1 229 000	EUR	1 075 746	1 060 185	0,03
Prosus NV 1.985% 21 - 13.07.33	1 450 000	EUR	1 118 437	1 071 173	0,03
Prosus NV 2.031% 20 - 03.08.32	1 123 000	EUR	929 269	860 892	0,02
Prosus NV 2.085% 22 - 19.01.30	780 000	EUR	682 149	652 899	0,02
Prosus NV 2.778% 22 - 19.01.34	987 000	EUR	771 388	769 495	0,02
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.375% 20 - 19.05.26	1 334 000	EUR	1 266 711	1 258 069	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.75% 20 - 19.05.30	911 000	EUR	849 009	798 036	0,02
Redexis Gas Finance BV 1.875% 15 - 27.04.27	705 000	EUR	662 171	662 904	0,02
Redexis Gas Finance BV 1.875% 20 - 28.05.25	900 000	EUR	878 305	876 915	0,02
RELX Finance BV 0.50% 20 - 10.03.28	1 206 000	EUR	1 086 462	1 093 685	0,03
RELX Finance BV 0.875% 20 - 10.03.32	710 000	EUR	596 801	599 091	0,02
RELX Finance BV 1.375% 16 - 12.05.26	920 000	EUR	897 358	888 812	0,02
RELX Finance BV 1.50% 18 - 13.05.27	900 000	EUR	855 685	861 588	0,02
RELX Finance BV 3.75% 23 - 12.06.31	1 310 000	EUR	1 304 983	1 362 479	0,04
Ren Finance BV 0.50% 21 - 16.04.29	800 000	EUR	686 645	701 584	0,02
Ren Finance BV 1.75% 18 - 18.01.28	300 000	EUR	280 911	284 532	0,01
Ren Finance BV 2.50% 15 - 12.02.25	692 000	EUR	686 506	683 447	0,02
Rentokil Initial Finance BV 3.875% 22 - 27.06.27	1 440 000	EUR	1 445 736	1 467 720	0,04
Rentokil Initial Finance BV 4.375% 22 - 27.06.30	870 000	EUR	887 272	919 494	0,02
Repsol International Finance BV 0.25% 19 - 02.08.27	1 200 000	EUR	1 105 063	1 086 744	0,03
Repsol International Finance BV 2.00% 20 - 15.12.25	1 300 000	EUR	1 276 993	1 270 581	0,03
Repsol International Finance BV 2.25% 14 - 10.12.26	500 000	EUR	496 421	488 910	0,01
Repsol International Finance BV FRN 21 - 31.12.99	1 082 000	EUR	945 586	1 011 464	0,03
Repsol International Finance BV 2.625% 20 - 15.04.30	1 200 000	EUR	1 192 366	1 178 808	0,03
Repsol International Finance BV FRN 20 - 31.12.99	982 000	EUR	920 455	961 349	0,02
Repsol International Finance BV FRN 20 - 31.12.99	1 082 000	EUR	978 784	1 055 199	0,03
Repsol International Finance BV FRN 15 - 25.03.75	1 100 000	EUR	1 071 731	1 096 447	0,03
REWE International Finance BV 4.875% 23 - 13.09.30	1 500 000	EUR	1 500 050	1 590 240	0,04
Robert Bosch Investment Nederland BV 2.625% 13 - 24.05.28	1 000 000	EUR	994 463	989 010	0,03
Roche Finance Europe BV 0.875% 15 - 25.02.25	1 540 000	EUR	1 518 850	1 503 625	0,04
Roche Finance Europe BV 3.204% 23 - 27.08.29	1 090 000	EUR	1 080 649	1 118 765	0,03
Roche Finance Europe BV 3.312% 23 - 04.12.27	700 000	EUR	710 266	716 478	0,02
Roche Finance Europe BV 3.355% 23 - 27.02.35	700 000	EUR	697 392	730 520	0,02
Roche Finance Europe BV 3.586% 23 - 04.12.36	1 500 000	EUR	1 513 242	1 586 475	0,04
Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 21 - 26.01.28	829 000	EUR	694 534	708 289	0,02
Sagax Euro Mtn NL BV 1.00% 21 - 17.05.29	705 000	EUR	591 116	576 352	0,01
Sagax Euro Mtn NL BV 1.625% 22 - 24.02.26	300 000	EUR	280 617	284 355	0,01
Sandoz Finance BV 3.97% 23 - 17.04.27	850 000	EUR	856 791	866 924	0,02
Sandoz Finance BV 4.22% 23 - 17.04.30	1 000 000	EUR	1 015 061	1 036 640	0,03
Sandoz Finance BV 4.50% 23 - 17.11.33	990 000	EUR	1 014 035	1 049 865	0,03
Sartorius Finance BV 4.25% 23 - 14.09.26	800 000	EUR	801 261	817 872	0,02
Sartorius Finance BV 4.375% 23 - 14.09.29	1 000 000	EUR	996 681	1 036 150	0,03
Sartorius Finance BV 4.50% 23 - 14.09.32	1 200 000	EUR	1 184 910	1 249 704	0,03
Sartorius Finance BV 4.875% 23 - 14.09.35	1 300 000	EUR	1 281 518	1 370 720	0,04
Schlumberger Finance BV 0.25% 19 - 15.10.27	1 573 000	EUR	1 419 743	1 423 408	0,04
Schlumberger Finance BV 0.50% 19 - 15.10.31	1 404 000	EUR	1 171 859	1 159 479	0,03
Schlumberger Finance BV 1.375% 20 - 28.10.26	1 490 000	EUR	1 441 637	1 422 980	0,04
Schlumberger Finance BV 2.00% 20 - 06.05.32	1 414 000	EUR	1 305 843	1 299 056	0,03
SGS Nederland Holdings BV 0.125% 21 - 21.04.27	1 200 000	EUR	1 089 044	1 089 360	0,03
Shell International Finance BV 0.125% 19 - 08.11.27	1 298 000	EUR	1 198 989	1 173 262	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.375% 16 - 15.02.25	1 678 000	EUR	1 646 130	1 625 613	0,04
Shell International Finance BV 0.50% 19 - 08.11.31	1 700 000	EUR	1 414 306	1 408 246	0,04
Shell International Finance BV 0.75% 16 - 15.08.28	1 500 000	EUR	1 406 462	1 365 600	0,04
Shell International Finance BV 0.875% 19 - 08.11.39	1 500 000	EUR	1 050 831	1 035 195	0,03
Shell International Finance BV 1.25% 16 - 12.05.28	1 600 000	EUR	1 531 211	1 494 656	0,04
Shell International Finance BV 1.25% 20 - 11.11.32	1 500 000	EUR	1 314 290	1 288 335	0,03
Shell International Finance BV 1.50% 20 - 07.04.28	997 000	EUR	929 111	943 052	0,02
Shell International Finance BV 1.50% 20 - 07.04.28	600 000	EUR	598 861	567 534	0,01
Shell International Finance BV 1.625% 14 - 20.01.27	1 638 000	EUR	1 612 656	1 578 016	0,04
Shell International Finance BV 1.875% 15 - 15.09.25	1 700 000	EUR	1 666 313	1 665 167	0,04
Shell International Finance BV 1.875% 20 - 07.04.32	1 432 000	EUR	1 356 294	1 312 070	0,03
Shell International Finance BV 2.50% 14 - 24.03.26	1 400 000	EUR	1 406 804	1 387 680	0,04
Siemens Energy Finance BV 4.00% 23 - 05.04.26	1 100 000	EUR	1 094 820	1 085 480	0,03
Siemens Energy Finance BV 4.25% 23 - 05.04.29	1 200 000	EUR	1 183 144	1 168 548	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 20 - 20.02.26	1 600 000	EUR	1 524 711	1 507 376	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.125% 19 - 05.09.29	1 457 000	EUR	1 276 930	1 299 586	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.25% 20 - 20.02.29	1 400 000	EUR	1 282 499	1 236 452	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.375% 20 - 05.06.26	1 200 000	EUR	1 155 662	1 132 032	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.50% 19 - 05.09.34	1 290 000	EUR	1 112 373	1 003 233	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.50% 20 - 20.02.32	1 100 000	EUR	952 964	910 888	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.625% 22 - 25.02.27	700 000	EUR	666 398	654 801	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.90% 19 - 28.02.28	900 000	EUR	846 735	841 248	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.00% 18 - 06.09.27	1 131 000	EUR	1 073 988	1 076 554	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.00% 22 - 25.02.30	1 300 000	EUR	1 157 001	1 171 560	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.25% 19 - 28.02.31	1 399 000	EUR	1 263 436	1 264 150	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.25% 22 - 25.02.35	1 200 000	EUR	1 007 418	1 001 328	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.375% 18 - 06.09.30	1 310 000	EUR	1 221 466	1 202 174	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.75% 19 - 28.02.39	1 163 000	EUR	1 017 679	964 011	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.25% 22 - 10.03.25	1 400 000	EUR	1 383 372	1 381 506	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.50% 22 - 08.09.27	600 000	EUR	583 474	596 724	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.75% 22 - 09.09.30	900 000	EUR	877 314	896 103	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.875% 13 - 10.03.28	1 652 000	EUR	1 672 447	1 670 767	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.00% 22 - 08.09.33	1 600 000	EUR	1 552 970	1 600 096	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.375% 23 - 24.08.31	1 700 000	EUR	1 672 253	1 752 649	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.50% 23 - 24.02.36	800 000	EUR	765 659	827 560	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.625% 23 - 24.02.43	1 100 000	EUR	1 025 992	1 144 627	0,03
Signify NV 2.375% 20 - 11.05.27	689 000	EUR	671 173	668 158	0,02
Sika Capital BV 0.875% 19 - 29.04.27	877 000	EUR	815 737	819 565	0,02
Sika Capital BV 1.50% 19 - 29.04.31	570 000	EUR	511 933	513 097	0,01
Sika Capital BV 3.75% 23 - 03.11.26	1 600 000	EUR	1 596 620	1 626 496	0,04
Sika Capital BV 3.75% 23 - 03.05.30	1 140 000	EUR	1 132 907	1 173 265	0,03
Stellantis NV 0.625% 21 - 30.03.27	1 858 000	EUR	1 736 568	1 712 147	0,04
Stellantis NV 0.75% 21 - 18.01.29	1 700 000	EUR	1 493 466	1 510 586	0,04
Stellantis NV 1.125% 19 - 18.09.29	800 000	EUR	701 065	718 232	0,02
Stellantis NV 1.25% 21 - 20.06.33	2 010 000	EUR	1 600 141	1 619 135	0,04
Stellantis NV 2.00% 18 - 20.03.25	900 000	EUR	891 166	882 585	0,02
Stellantis NV 2.75% 20 - 15.05.26	1 600 000	EUR	1 585 692	1 582 416	0,04
Stellantis NV 2.75% 22 - 01.04.32	1 357 000	EUR	1 247 088	1 269 175	0,03
Stellantis NV 3.875% 20 - 05.01.26	1 934 000	EUR	2 103 101	1 950 458	0,05
Stellantis NV 4.25% 23 - 16.06.31	1 830 000	EUR	1 801 275	1 898 735	0,05
Stellantis NV 4.375% 23 - 14.03.30	1 740 000	EUR	1 747 740	1 837 805	0,05
Stellantis NV 4.50% 20 - 07.07.28	1 427 000	EUR	1 514 217	1 502 374	0,04
STG Global Finance BV 1.375% 20 - 24.09.25	528 000	EUR	494 525	493 865	0,01
Sudzucker International Finance BV 1.00% 17 - 28.11.25	800 000	EUR	764 657	761 744	0,02
Sudzucker International Finance BV 5.125% 22 - 31.10.27	500 000	EUR	509 105	527 705	0,01
Technip Energies NV 1.125% 21 - 28.05.28	700 000	EUR	621 558	631 435	0,02
Telefonica Europe BV 5.875% 03 - 14.02.33	891 000	EUR	1 089 128	1 069 779	0,03
Thermo Fisher Scientific Finance I BV Zero Coupon 21 - 18.11.25	979 000	EUR	920 287	923 726	0,02
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 0.80% 21 - 18.10.30	2 450 000	EUR	2 192 130	2 126 379	0,05
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.125% 21 - 18.10.33	2 216 000	EUR	1 896 082	1 840 166	0,05
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 21 - 18.10.41	1 963 000	EUR	1 536 471	1 478 865	0,04
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 2.00% 21 - 18.10.51	1 100 000	EUR	800 786	787 270	0,02
Toyota Motor Finance Netherlands BV Zero Coupon 21 - 25.02.28	500 000	EUR	458 996	443 530	0,01
Toyota Motor Finance Netherlands BV Zero Coupon 21 - 27.10.25	1 210 000	EUR	1 148 883	1 142 434	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Toyota Motor Finance Netherlands BV 3.375% 23 - 13.01.26	1 150 000	EUR	1 144 203	1 154 405	0,03
Toyota Motor Finance Netherlands BV 3.50% 23 - 13.01.28	652 000	EUR	648 825	664 199	0,02
Toyota Motor Finance Netherlands BV 3.625% 23 - 24.04.25	600 000	EUR	598 960	601 734	0,02
Toyota Motor Finance Netherlands BV 4.00% 23 - 02.04.27	1 100 000	EUR	1 104 402	1 133 638	0,03
Unilever Finance Netherlands BV 0.50% 18 - 06.01.25	894 000	EUR	877 230	869 022	0,02
Unilever Finance Netherlands BV 0.75% 22 - 28.02.26	710 000	EUR	682 152	678 441	0,02
Unilever Finance Netherlands BV 0.875% 17 - 31.07.25	650 000	EUR	636 830	628 076	0,02
Unilever Finance Netherlands BV 1.00% 17 - 14.02.27	867 000	EUR	827 304	822 020	0,02
Unilever Finance Netherlands BV 1.125% 16 - 29.04.28	1 200 000	EUR	1 130 630	1 121 868	0,03
Unilever Finance Netherlands BV 1.125% 18 - 12.02.27	1 178 000	EUR	1 139 935	1 121 197	0,03
Unilever Finance Netherlands BV 1.25% 20 - 25.03.25	1 714 000	EUR	1 694 583	1 671 184	0,04
Unilever Finance Netherlands BV 1.25% 22 - 28.02.31	1 063 000	EUR	942 890	949 472	0,02
Unilever Finance Netherlands BV 1.375% 17 - 31.07.29	899 000	EUR	841 825	834 218	0,02
Unilever Finance Netherlands BV 1.375% 18 - 04.09.30	1 100 000	EUR	997 312	1 004 256	0,03
Unilever Finance Netherlands BV 1.625% 18 - 12.02.33	1 322 000	EUR	1 187 914	1 187 024	0,03
Unilever Finance Netherlands BV 1.75% 20 - 25.03.30	1 508 000	EUR	1 451 362	1 415 047	0,04
Unilever Finance Netherlands BV 1.75% 22 - 16.11.28	1 219 000	EUR	1 154 640	1 164 706	0,03
Unilever Finance Netherlands BV 2.25% 22 - 16.05.34	1 310 000	EUR	1 206 945	1 226 396	0,03
Unilever Finance Netherlands BV 3.25% 23 - 23.02.31	590 000	EUR	582 399	603 269	0,02
Unilever Finance Netherlands BV 3.50% 23 - 23.02.35	660 000	EUR	653 194	688 816	0,02
Universal Music Group NV 3.00% 22 - 30.06.27	1 000 000	EUR	975 183	1 000 480	0,03
Universal Music Group NV 3.75% 22 - 30.06.32	700 000	EUR	685 728	721 007	0,02
Universal Music Group NV 4.00% 23 - 13.06.31	1 000 000	EUR	995 392	1 045 070	0,03
Upjohn Finance BV 1.362% 20 - 23.06.27	1 389 000	EUR	1 284 270	1 289 575	0,03
Upjohn Finance BV 1.908% 20 - 23.06.32	1 943 000	EUR	1 629 436	1 631 751	0,04
Vestas Wind Systems Finance BV 1.50% 22 - 15.06.29	900 000	EUR	825 115	824 517	0,02
Vestas Wind Systems Finance BV 2.00% 22 - 15.06.34	679 000	EUR	576 186	594 132	0,02
Vesteda Finance BV 0.75% 21 - 18.10.31	705 000	EUR	554 036	565 770	0,01
Vesteda Finance BV 1.50% 19 - 24.05.27	902 000	EUR	848 331	850 568	0,02
Vesteda Finance BV 2.00% 18 - 10.07.26	816 000	EUR	779 547	784 315	0,02
VIA Outlets BV 1.75% 21 - 15.11.28	832 000	EUR	717 721	738 999	0,02
Viterra Finance BV 0.375% 21 - 24.09.25	808 000	EUR	760 817	762 946	0,02
Viterra Finance BV 1.00% 21 - 24.09.28	1 111 000	EUR	981 132	987 990	0,03
Volkswagen International Finance NV 0.875% 20 - 22.09.28	2 100 000	EUR	1 888 777	1 879 332	0,05
Volkswagen International Finance NV 1.25% 20 - 23.09.32	1 000 000	EUR	822 510	832 160	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Volkswagen International Finance NV 1.50% 21 - 21.01.41	500 000	EUR	310 058	355 815	0,01
Volkswagen International Finance NV 1.625% 15 - 16.01.30	1 356 000	EUR	1 254 841	1 226 353	0,03
Volkswagen International Finance NV 1.875% 17 - 30.03.27	3 800 000	EUR	3 669 089	3 632 116	0,09
Volkswagen International Finance NV 2.625% 18 - 16.11.27	1 100 000	EUR	1 076 808	1 070 718	0,03
Volkswagen International Finance NV 2.625% 18 - 16.11.27	200 000	EUR	202 075	194 676	0,01
Volkswagen International Finance NV 3.125% 22 - 28.03.25	1 100 000	EUR	1 099 092	1 093 345	0,03
Volkswagen International Finance NV 3.25% 18 - 18.11.30	1 500 000	EUR	1 448 440	1 483 890	0,04
Volkswagen International Finance NV 3.30% 13 - 22.03.33	1 200 000	EUR	1 204 779	1 183 548	0,03
Volkswagen International Finance NV FRN 15 - 29.12.49	2 107 000	EUR	1 879 818	1 884 880	0,05
Volkswagen International Finance NV FRN 20 - 31.12.99	2 100 000	EUR	2 021 398	2 042 418	0,05
Volkswagen International Finance NV FRN 22 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 357 316	1 404 990	0,04
Volkswagen International Finance NV 3.75% 22 - 28.09.27	1 100 000	EUR	1 100 238	1 115 818	0,03
Volkswagen International Finance NV FRN 17 - 31.12.99	3 000 000	EUR	2 842 235	2 858 160	0,07
Volkswagen International Finance NV FRN 20 - 31.12.99	2 300 000	EUR	2 055 370	2 107 260	0,05
Volkswagen International Finance NV 3.875% 23 - 29.03.26	1 500 000	EUR	1 492 178	1 511 100	0,04
Volkswagen International Finance NV 4.125% 18 - 16.11.38	1 900 000	EUR	1 974 090	1 967 070	0,05
Volkswagen International Finance NV 4.125% 22 - 15.11.25	1 500 000	EUR	1 505 238	1 518 660	0,04
Volkswagen International Finance NV 4.25% 22 - 15.02.28	1 300 000	EUR	1 299 752	1 341 912	0,03
Volkswagen International Finance NV 4.25% 23 - 29.03.29	1 200 000	EUR	1 191 226	1 247 460	0,03
Volkswagen International Finance NV FRN 22 - 31.12.99	1 900 000	EUR	1 672 024	1 721 723	0,04
Volkswagen International Finance NV 4.375% 22 - 15.05.30	900 000	EUR	905 777	945 360	0,02
Volkswagen International Finance NV FRN 14 - 29.03.49	2 583 000	EUR	2 580 622	2 561 122	0,07
Volkswagen International Finance NV FRN 18 - 31.12.99	2 200 000	EUR	2 100 869	2 131 404	0,06
Volkswagen International Finance NV FRN 23 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 531 118	1 631 115	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Volkswagen International Finance NV FRN 23 - 31.12.99	1 100 000	EUR	1 134 240	1 237 764	0,03
Vonovia Finance BV 0.50% 19 - 14.09.29	700 000	EUR	617 526	576 597	0,01
Vonovia Finance BV 0.625% 19 - 07.10.27	500 000	EUR	458 100	447 535	0,01
Vonovia Finance BV 0.625% 20 - 09.07.26	1 000 000	EUR	933 754	932 610	0,02
Vonovia Finance BV 1.00% 20 - 09.07.30	1 000 000	EUR	874 353	828 910	0,02
Vonovia Finance BV 1.00% 21 - 28.01.41	900 000	EUR	560 495	536 724	0,01
Vonovia Finance BV 1.125% 17 - 08.09.25	800 000	EUR	759 984	765 800	0,02
Vonovia Finance BV 1.125% 19 - 14.09.34	800 000	EUR	585 036	596 584	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 15 - 31.03.25	700 000	EUR	682 150	680 561	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 16 - 10.06.26	800 000	EUR	762 950	763 096	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 14.01.28	600 000	EUR	550 718	549 522	0,01
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 22.03.26	1 100 000	EUR	1 064 839	1 052 018	0,03
Vonovia Finance BV 1.625% 19 - 07.10.39	600 000	EUR	435 596	413 436	0,01
Vonovia Finance BV 1.75% 17 - 25.01.27	600 000	EUR	560 428	570 174	0,01
Vonovia Finance BV 1.80% 19 - 29.06.25	800 000	EUR	782 308	773 896	0,02
Vonovia Finance BV 2.125% 18 - 22.03.30	800 000	EUR	702 719	716 032	0,02
Vonovia Finance BV 2.25% 20 - 07.04.30	700 000	EUR	644 148	629 433	0,02
Vonovia Finance BV 2.75% 18 - 22.03.38	800 000	EUR	614 556	673 360	0,02
Wabtec Transportation Netherlands BV 1.25% 21 - 03.12.27	726 000	EUR	650 570	668 965	0,02
Wintershall Dea Finance BV 0.84% 19 - 25.09.25	1 700 000	EUR	1 618 775	1 620 100	0,04
Wintershall Dea Finance BV 1.332% 19 - 25.09.28	1 500 000	EUR	1 342 372	1 341 510	0,03
Wintershall Dea Finance BV 1.823% 19 - 25.09.31	1 500 000	EUR	1 250 144	1 291 710	0,03
Wolters Kluwer NV 0.25% 21 - 30.03.28	700 000	EUR	621 038	628 208	0,02
Wolters Kluwer NV 0.75% 20 - 03.07.30	905 000	EUR	771 633	785 766	0,02
Wolters Kluwer NV 1.50% 17 - 22.03.27	711 000	EUR	682 884	679 524	0,02
Wolters Kluwer NV 3.00% 22 - 23.09.26	900 000	EUR	885 964	901 602	0,02
Wolters Kluwer NV 3.75% 23 - 03.04.31	900 000	EUR	897 623	933 372	0,02
WPC Eurobond BV 0.95% 21 - 01.06.30	812 000	EUR	667 936	674 252	0,02
WPC Eurobond BV 1.35% 19 - 15.04.28	667 000	EUR	606 170	610 332	0,02
WPC Eurobond BV 2.125% 18 - 15.04.27	500 000	EUR	483 029	474 705	0,01
WPC Eurobond BV 2.25% 18 - 09.04.26	1 100 000	EUR	1 063 941	1 064 591	0,03
Wurth Finance International BV 0.75% 20 - 22.11.27	1 243 000	EUR	1 135 498	1 148 321	0,03
Wurth Finance International BV 1.00% 18 - 26.05.25	700 000	EUR	681 748	678 377	0,02
Wurth Finance International BV 2.125% 22 - 23.08.30	872 000	EUR	803 830	821 005	0,02
			645 819 680	648 060 906	16,77
Nouvelle-Zélande					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.20% 21 - 23.09.27	1 200 000	EUR	1 084 713	1 073 208	0,03
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.375% 19 - 17.09.29	1 012 000	EUR	849 179	867 274	0,02
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 1.125% 18 - 20.03.25	900 000	EUR	876 863	873 630	0,02
ASB Bank Ltd. 0.25% 21 - 08.09.28	1 320 000	EUR	1 148 561	1 150 631	0,03
ASB Bank Ltd. 0.50% 19 - 24.09.29	771 000	EUR	647 721	664 501	0,02
ASB Bank Ltd. 4.50% 23 - 16.03.27	800 000	EUR	808 268	825 840	0,02
Chorus Ltd. 0.875% 19 - 05.12.26	500 000	EUR	457 297	466 570	0,01
Chorus Ltd. 3.625% 22 - 07.09.29	690 000	EUR	676 901	701 330	0,02
Westpac Securities NZ Ltd. 0.10% 21 - 13.07.27	1 080 000	EUR	991 800	966 211	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Westpac Securities NZ Ltd. 0.427% 21 - 14.12.26	1 118 000	EUR	1 019 851	1 027 554	0,03
Westpac Securities NZ Ltd. 1.099% 22 - 24.03.26	1 066 000	EUR	1 014 547	1 011 346	0,03
			9 575 701	9 628 095	0,25
Norvège					
Aker BP ASA 1.125% 21 - 12.05.29	1 058 000	EUR	925 517	942 657	0,02
DNB Bank ASA FRN 21 - 23.02.29	1 700 000	EUR	1 492 508	1 491 155	0,04
DNB Bank ASA FRN 22 - 18.01.28	1 357 000	EUR	1 245 334	1 243 419	0,03
DNB Bank ASA FRN 22 - 31.05.26	1 014 000	EUR	987 904	987 413	0,03
DNB Bank ASA FRN 22 - 21.09.27	1 680 000	EUR	1 654 341	1 674 658	0,04
DNB Bank ASA FRN 23 - 16.02.27	1 541 000	EUR	1 523 471	1 545 854	0,04
DNB Bank ASA FRN 23 - 14.03.29	1 400 000	EUR	1 411 259	1 442 938	0,04
DNB Bank ASA FRN 23 - 19.07.28	1 770 000	EUR	1 782 600	1 829 171	0,05
DNB Bank ASA FRN 22 - 28.02.33	1 207 000	EUR	1 196 630	1 235 883	0,03
DNB Bank ASA FRN 23 - 01.11.29	1 290 000	EUR	1 303 425	1 355 842	0,04
DNB Bank ASA FRN 23 - 13.09.33	640 000	EUR	636 614	666 240	0,02
Norsk Hydro ASA 1.125% 19 - 11.04.25	500 000	EUR	486 642	483 160	0,01
Norsk Hydro ASA 2.00% 19 - 11.04.29	450 000	EUR	404 246	414 945	0,01
Santander Consumer Bank AS 0.125% 20 - 25.02.25	600 000	EUR	579 415	575 802	0,01
Santander Consumer Bank AS 0.125% 21 - 14.04.26	1 100 000	EUR	1 016 633	1 019 238	0,03
Santander Consumer Bank AS 0.50% 22 - 11.08.25	500 000	EUR	477 960	475 340	0,01
Sparebank 1 Oestlandet 0.125% 21 - 03.03.28	478 000	EUR	421 711	420 042	0,01
Sparebank 1 Oestlandet 1.75% 22 - 27.04.27	977 000	EUR	912 536	929 147	0,02
SpareBank 1 SMN 0.01% 21 - 18.02.28	703 000	EUR	595 371	617 417	0,02
SpareBank 1 SMN 0.125% 19 - 11.09.26	768 000	EUR	702 207	706 806	0,02
SpareBank 1 SMN 3.125% 22 - 22.12.25	800 000	EUR	786 360	795 040	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.25% 21 - 09.11.26	726 000	EUR	669 571	667 121	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA FRN 21 - 15.07.27	556 000	EUR	517 759	509 518	0,01
SpareBank 1 SR-Bank ASA 2.875% 22 - 20.09.25	900 000	EUR	884 109	891 810	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA 3.75% 23 - 23.11.27	1 400 000	EUR	1 385 685	1 424 626	0,04
SpareBank 1 SR-Bank ASA 4.875% 23 - 24.08.28	900 000	EUR	905 284	947 448	0,02
Storebrand Livsforsikring AS FRN 21 - 30.09.51	400 000	EUR	296 845	318 700	0,01
Var Energi ASA 5.50% 23 - 04.05.29	1 000 000	EUR	1 007 542	1 069 750	0,03
			26 209 479	26 681 140	0,69
Pologne					
Bank Polska Kasa Opieki SA FRN 23 - 23.11.27	740 000	EUR	748 491	755 266	0,02
ORLEN SA 1.125% 21 - 27.05.28	500 000	EUR	434 216	450 950	0,01
ORLEN SA 4.75% 23 - 13.07.30	900 000	EUR	892 064	933 993	0,03
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA FRN 23 - 01.02.26	1 100 000	EUR	1 105 426	1 112 914	0,03
Tauron Polska Energia SA 2.375% 17 - 05.07.27	557 000	EUR	494 546	518 350	0,01
			3 674 743	3 771 473	0,10
Portugal					
Banco Comercial Portugues SA FRN 21 - 12.02.27	700 000	EUR	646 909	661 724	0,02
Banco Comercial Portugues SA FRN 21 - 07.04.28	600 000	EUR	527 415	560 424	0,01
Banco Comercial Portugues SA FRN 23 - 02.10.26	900 000	EUR	900 924	925 362	0,02
Brisa-Concessao Rodoviaria SA 1.875% 15 - 30.04.25	400 000	EUR	393 884	391 512	0,01
Brisa-Concessao Rodoviaria SA 2.375% 17 - 10.05.27	500 000	EUR	487 280	485 670	0,01
EDP - Energias de Portugal SA 1.625% 20 - 15.04.27	900 000	EUR	879 054	861 165	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
EDP - Energias de Portugal SA 2.875% 16 - 01.06.26	600 000	EUR	599 403	594 954	0,02
EDP - Energias de Portugal SA 3.875% 23 - 26.06.28	1 200 000	EUR	1 195 466	1 233 240	0,03
Fidelidade - Cia de Seguros SA FRN 21 - 04.09.31	700 000	EUR	632 628	624 106	0,02
Floene Energias SA 4.875% 23 - 03.07.28	600 000	EUR	598 713	622 212	0,02
			6 861 676	6 960 369	0,18
Roumanie					
Banca Comerciala Romana SA FRN 23 - 19.05.27	1 000 000	EUR	1 019 339	1 055 840	0,03
Raiffeisen Bank SA FRN 23 - 12.10.27	400 000	EUR	404 140	412 520	0,01
			1 423 479	1 468 360	0,04
Singapour					
CapitaLand Ascendas REIT 0.75% 21 - 23.06.28	300 000	EUR	243 770	255 852	0,01
			243 770	255 852	0,01
Slovaquie					
Slovenska Sporitelna AS FRN 23 - 04.10.28	500 000	EUR	499 561	515 615	0,01
Tatra Banka AS FRN 21 - 23.04.28	400 000	EUR	325 837	339 996	0,01
Tatra Banka AS FRN 23 - 17.02.26	300 000	EUR	298 440	303 789	0,01
			1 123 838	1 159 400	0,03
Slovénie					
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. FRN 23 - 29.06.26	500 000	EUR	505 284	516 230	0,02
Nova Ljubljanska Banka d.d. FRN 23 - 27.06.27	800 000	EUR	828 129	843 208	0,02
			1 333 413	1 359 438	0,04
Espagne					
Abanca Corp Bancaria SA FRN 23 - 02.04.30	800 000	EUR	793 728	852 424	0,02
Abanca Corp. Bancaria SA FRN 21 - 08.09.27	700 000	EUR	618 765	638 953	0,02
Abanca Corp. Bancaria SA FRN 22 - 14.09.28	700 000	EUR	692 787	725 795	0,02
Abanca Corp. Bancaria SA FRN 23 - 18.05.26	900 000	EUR	899 645	914 247	0,02
Abertis Infraestructuras SA 0.625% 19 - 15.07.25	700 000	EUR	675 105	670 341	0,02
Abertis Infraestructuras SA 1.00% 16 - 27.02.27	600 000	EUR	581 969	564 108	0,01
Abertis Infraestructuras SA 1.125% 19 - 26.03.28	1 100 000	EUR	1 021 072	1 007 644	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.25% 20 - 07.02.28	1 100 000	EUR	1 011 801	1 014 101	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.375% 16 - 20.05.26	1 300 000	EUR	1 247 498	1 255 215	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.625% 19 - 15.07.29	1 100 000	EUR	986 994	997 898	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.875% 19 - 26.03.32	900 000	EUR	774 079	779 733	0,02
Abertis Infraestructuras SA 2.25% 20 - 29.03.29	1 400 000	EUR	1 303 750	1 314 516	0,03
Abertis Infraestructuras SA 2.375% 19 - 27.09.27	1 500 000	EUR	1 458 293	1 461 180	0,04
Abertis Infraestructuras SA 2.50% 14 - 27.02.25	800 000	EUR	791 563	789 000	0,02
Abertis Infraestructuras SA 3.00% 19 - 27.03.31	1 400 000	EUR	1 324 005	1 334 718	0,03
Abertis Infraestructuras SA 4.125% 23 - 07.08.29	700 000	EUR	684 513	718 998	0,02
Abertis Infraestructuras SA 4.125% 23 - 31.01.28	1 000 000	EUR	995 421	1 028 590	0,03
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 0.375% 21 - 07.10.27	900 000	EUR	814 677	806 571	0,02
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 1.375% 22 - 26.01.32	700 000	EUR	599 206	586 719	0,02
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 3.75% 23 - 25.04.30	800 000	EUR	776 833	789 712	0,02
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 5.125% 23 - 23.04.31	700 000	EUR	699 528	738 857	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA 1.875% 18 - 20.04.26	600 000	EUR	587 542	580 728	0,01
Amadeus IT Group SA 1.50% 18 - 18.09.26	600 000	EUR	574 193	582 630	0,01
Amadeus IT Group SA 1.875% 20 - 24.09.28	700 000	EUR	646 848	667 758	0,02
Amadeus IT Group SA 2.875% 20 - 20.05.27	1 000 000	EUR	993 566	991 250	0,03
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 21 - 24.03.27	1 500 000	EUR	1 400 075	1 396 755	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 15.11.26	1 500 000	EUR	1 406 898	1 389 075	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.50% 20 - 14.01.27	2 000 000	EUR	1 830 351	1 844 860	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 20 - 04.06.25	1 600 000	EUR	1 544 874	1 542 096	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 22 - 14.01.29	1 500 000	EUR	1 323 785	1 360 035	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.00% 19 - 21.06.26	1 600 000	EUR	1 524 339	1 519 632	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 20 - 16.01.30	1 300 000	EUR	1 236 504	1 250 340	0,03
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.375% 18 - 14.05.25	1 300 000	EUR	1 271 514	1 261 091	0,03
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.75% 22 - 26.11.25	1 900 000	EUR	1 846 936	1 848 377	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.375% 22 - 20.09.27	2 100 000	EUR	2 057 688	2 119 866	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.50% 17 - 10.02.27	1 500 000	EUR	1 518 467	1 501 665	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 23 - 10.05.26	1 600 000	EUR	1 597 147	1 610 208	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 4.375% 22 - 14.10.29	1 700 000	EUR	1 721 918	1 805 706	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 23 - 13.01.31	1 600 000	EUR	1 615 561	1 678 272	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 23 - 15.09.33	1 100 000	EUR	1 092 536	1 156 859	0,03
Banco de Sabadell SA 0.875% 19 - 22.07.25	1 700 000	EUR	1 635 348	1 636 080	0,04
Banco de Sabadell SA FRN 20 - 11.03.27	900 000	EUR	838 991	854 145	0,02
Banco de Sabadell SA FRN 23 - 07.06.29	900 000	EUR	900 474	946 008	0,02
Banco de Sabadell SA FRN 22 - 10.11.28	1 300 000	EUR	1 316 204	1 366 573	0,04
Banco Santander SA 0.20% 21 - 11.02.28	2 000 000	EUR	1 782 757	1 768 760	0,05
Banco Santander SA 0.30% 19 - 04.10.26	1 300 000	EUR	1 225 957	1 207 765	0,03
Banco Santander SA 0.50% 20 - 04.02.27	1 900 000	EUR	1 760 390	1 743 326	0,04
Banco Santander SA FRN 21 - 24.03.27	1 500 000	EUR	1 398 618	1 399 875	0,04
Banco Santander SA FRN 21 - 24.06.29	1 300 000	EUR	1 157 169	1 150 981	0,03
Banco Santander SA 1.00% 21 - 04.11.31	1 600 000	EUR	1 325 646	1 370 160	0,04
Banco Santander SA 1.125% 18 - 17.01.25	1 700 000	EUR	1 671 926	1 654 032	0,04
Banco Santander SA 1.125% 20 - 23.06.27	1 600 000	EUR	1 472 159	1 493 200	0,04
Banco Santander SA 1.375% 20 - 05.01.26	2 400 000	EUR	2 315 642	2 301 960	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Santander SA 1.625% 20 - 22.10.30	1 400 000	EUR	1 168 059	1 205 862	0,03
Banco Santander SA 2.125% 18 - 08.02.28	1 900 000	EUR	1 791 033	1 798 103	0,05
Banco Santander SA 2.50% 15 - 18.03.25	2 300 000	EUR	2 270 706	2 268 260	0,06
Banco Santander SA 3.125% 17 - 19.01.27	1 400 000	EUR	1 403 737	1 388 226	0,04
Banco Santander SA 3.25% 16 - 04.04.26	2 000 000	EUR	1 995 825	1 987 460	0,05
Banco Santander SA FRN 22 - 27.09.26	2 500 000	EUR	2 480 065	2 503 600	0,06
Banco Santander SA 3.75% 23 - 16.01.26	2 400 000	EUR	2 394 829	2 420 328	0,06
Banco Santander SA 3.875% 23 - 16.01.28	1 800 000	EUR	1 798 963	1 842 948	0,05
Banco Santander SA 4.25% 23 - 12.06.30	1 600 000	EUR	1 601 160	1 671 824	0,04
Banco Santander SA FRN 23 - 18.10.27	2 000 000	EUR	1 997 383	2 049 060	0,05
Banco Santander SA 4.875% 23 - 18.10.31	2 900 000	EUR	2 889 947	3 087 949	0,08
Banco Santander SA FRN 23 - 23.08.33	2 300 000	EUR	2 295 036	2 411 711	0,06
Bankinter SA 0.625% 20 - 06.10.27	1 200 000	EUR	1 087 304	1 092 192	0,03
Bankinter SA 0.875% 19 - 08.07.26	900 000	EUR	838 230	846 495	0,02
Bankinter SA FRN 21 - 23.12.32	1 000 000	EUR	877 034	891 320	0,02
Bankinter SA FRN 23 - 03.05.30	900 000	EUR	897 390	933 435	0,02
Bankinter SA FRN 23 - 13.09.31	800 000	EUR	793 478	837 784	0,02
CaixaBank SA 0.375% 20 - 03.02.25	1 600 000	EUR	1 558 439	1 544 832	0,04
CaixaBank SA FRN 20 - 18.11.26	1 600 000	EUR	1 499 899	1 505 872	0,04
CaixaBank SA FRN 21 - 09.02.29	1 500 000	EUR	1 341 714	1 322 145	0,03
CaixaBank SA FRN 22 - 21.01.28	1 700 000	EUR	1 567 341	1 568 165	0,04
CaixaBank SA 0.75% 19 - 09.07.26	900 000	EUR	848 998	845 559	0,02
CaixaBank SA FRN 20 - 10.07.26	1 600 000	EUR	1 541 952	1 537 648	0,04
CaixaBank SA FRN 21 - 26.05.28	1 500 000	EUR	1 354 129	1 367 430	0,04
CaixaBank SA 1.125% 19 - 27.03.26	1 400 000	EUR	1 345 553	1 333 234	0,03
CaixaBank SA 1.125% 19 - 12.11.26	900 000	EUR	846 750	845 316	0,02
CaixaBank SA FRN 21 - 18.06.31	1 600 000	EUR	1 471 451	1 489 184	0,04
CaixaBank SA 1.375% 19 - 19.06.26	1 700 000	EUR	1 621 912	1 614 456	0,04
CaixaBank SA FRN 22 - 13.04.26	1 600 000	EUR	1 549 975	1 557 184	0,04
CaixaBank SA FRN 18 - 17.04.30	1 500 000	EUR	1 443 994	1 448 220	0,04
CaixaBank SA 3.75% 22 - 07.09.29	1 300 000	EUR	1 287 402	1 333 293	0,03
CaixaBank SA 4.25% 23 - 06.09.30	2 000 000	EUR	1 993 302	2 076 220	0,05
CaixaBank SA 4.375% 23 - 29.11.33	1 400 000	EUR	1 415 740	1 471 134	0,04
CaixaBank SA FRN 23 - 16.05.27	1 800 000	EUR	1 797 730	1 837 422	0,05
CaixaBank SA FRN 23 - 19.07.29	1 400 000	EUR	1 404 712	1 463 756	0,04
CaixaBank SA FRN 23 - 19.07.34	800 000	EUR	802 463	853 688	0,02
CaixaBank SA FRN 22 - 14.11.30	1 500 000	EUR	1 536 371	1 618 425	0,04
CaixaBank SA FRN 23 - 30.05.34	1 600 000	EUR	1 596 885	1 692 512	0,04
CaixaBank SA FRN 22 - 23.02.33	1 100 000	EUR	1 114 559	1 160 665	0,03
Criteria Caixa SA 0.875% 20 - 28.10.27	700 000	EUR	632 174	639 324	0,02
EDP Servicios Financieros Espana SA 4.125% 23 - 04.04.29	1 140 000	EUR	1 131 892	1 186 694	0,03
EDP Servicios Financieros Espana SA 4.375% 23 - 04.04.32	1 200 000	EUR	1 188 317	1 278 720	0,03
Enagas Financiaciones SA 0.375% 20 - 05.11.32	800 000	EUR	622 374	635 368	0,02
Enagas Financiaciones SA 0.75% 16 - 27.10.26	800 000	EUR	754 225	754 864	0,02
Enagas Financiaciones SA 1.25% 15 - 06.02.25	800 000	EUR	789 198	779 600	0,02
Enagas Financiaciones SA 1.375% 16 - 05.05.28	1 300 000	EUR	1 249 115	1 231 737	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
FCC Aqualia SA 2.629% 17 - 08.06.27	1 049 000	EUR	999 885	1 025 639	0,03
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU 5.25% 23 - 30.10.29	1 070 000	EUR	1 086 948	1 148 506	0,03
FCC Servicios Medio Ambiente Holdings SAU 1.661% 19 - 04.12.26	605 000	EUR	574 655	576 662	0,01
Ferrovial Emisiones SA 0.54% 20 - 12.11.28	700 000	EUR	618 613	620 732	0,02
Ferrovial Emisiones SA 1.375% 17 - 31.03.25	600 000	EUR	587 863	584 004	0,01
Ferrovial Emisiones SA 1.382% 20 - 14.05.26	1 000 000	EUR	974 682	963 110	0,02
Ibercaja Banco SA FRN 23 - 07.06.27	900 000	EUR	901 916	928 170	0,02
Iberdrola Finanzas SA 0.875% 20 - 16.06.25	1 200 000	EUR	1 168 710	1 157 304	0,03
Iberdrola Finanzas SA 1.00% 17 - 07.03.25	1 300 000	EUR	1 280 275	1 263 561	0,03
Iberdrola Finanzas SA 1.25% 17 - 13.09.27	1 200 000	EUR	1 140 798	1 145 160	0,03
Iberdrola Finanzas SA 1.25% 18 - 28.10.26	1 400 000	EUR	1 364 025	1 343 776	0,03
Iberdrola Finanzas SA 1.375% 22 - 11.03.32	1 400 000	EUR	1 254 089	1 241 884	0,03
Iberdrola Finanzas SA FRN 21 - 31.12.99	1 100 000	EUR	963 469	979 836	0,03
Iberdrola Finanzas SA 1.621% 17 - 29.11.29	1 300 000	EUR	1 262 867	1 232 439	0,03
Iberdrola Finanzas SA 3.125% 22 - 22.11.28	1 300 000	EUR	1 288 162	1 316 809	0,03
Iberdrola Finanzas SA 3.375% 22 - 22.11.32	1 100 000	EUR	1 086 173	1 122 088	0,03
Iberdrola Finanzas SA 3.625% 23 - 13.07.33	1 400 000	EUR	1 391 502	1 450 764	0,04
Iberdrola Finanzas SA FRN 23 - 25.01.30	1 400 000	EUR	1 370 896	1 412 488	0,04
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 0.75% 21 - 22.06.29	1 200 000	EUR	1 041 581	1 037 844	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.35% 20 - 14.10.28	600 000	EUR	538 557	553 356	0,01
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.625% 17 - 28.11.25	900 000	EUR	870 139	870 237	0,02
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.00% 18 - 17.04.26	1 200 000	EUR	1 166 854	1 161 264	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.50% 17 - 28.11.29	400 000	EUR	372 411	376 924	0,01
Kutxabank SA FRN 21 - 14.10.27	1 000 000	EUR	904 366	911 360	0,02
Kutxabank SA FRN 23 - 01.02.28	600 000	EUR	599 020	606 858	0,02
Kutxabank SA FRN 23 - 15.06.27	600 000	EUR	596 218	610 548	0,02
Lar Espana Real Estate Socimi SA 1.75% 21 - 22.07.26	400 000	EUR	358 835	359 196	0,01
Mapfre SA 1.625% 16 - 19.05.26	900 000	EUR	876 163	880 443	0,02
Mapfre SA 2.875% 22 - 13.04.30	700 000	EUR	636 100	638 757	0,02
Mapfre SA FRN 18 - 07.09.48	800 000	EUR	785 866	772 240	0,02
Mapfre SA FRN 17 - 31.03.47	1 100 000	EUR	1 081 222	1 084 050	0,03
Merlin Properties Socimi SA 1.375% 21 - 01.06.30	700 000	EUR	572 758	593 460	0,02
Merlin Properties Socimi SA 1.75% 17 - 26.05.25	800 000	EUR	782 076	777 472	0,02
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 16 - 02.11.26	1 175 000	EUR	1 133 798	1 131 090	0,03
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 19 - 04.12.34	800 000	EUR	621 257	632 592	0,02
Merlin Properties Socimi SA 2.375% 17 - 18.09.29	500 000	EUR	455 292	473 585	0,01
Merlin Properties Socimi SA 2.375% 20 - 13.07.27	1 000 000	EUR	949 244	962 530	0,02
NorteGas Energia Distribucion SA 0.905% 21 - 22.01.31	1 000 000	EUR	794 815	797 300	0,02
NorteGas Energia Distribucion SA 2.065% 17 - 28.09.27	900 000	EUR	862 040	846 855	0,02
Prosegur Cash SA 1.375% 17 - 04.02.26	1 100 000	EUR	1 059 895	1 053 415	0,03
Prosegur Cia de Seguridad SA 2.50% 22 - 06.04.29	600 000	EUR	549 696	571 890	0,01
Red Electrica Corp. SA 0.875% 20 - 14.04.25	400 000	EUR	395 249	387 096	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Corp. SA FRN 23 - 31.12.99	700 000	EUR	696 700	712 523	0,02
Red Electrica Financiaciones SAU 0.375% 20 - 24.07.28	1 300 000	EUR	1 157 200	1 175 772	0,03
Red Electrica Financiaciones SAU 0.50% 21 - 24.05.33	700 000	EUR	544 496	573 790	0,01
Red Electrica Financiaciones SAU 1.00% 16 - 21.04.26	800 000	EUR	769 528	768 328	0,02
Red Electrica Financiaciones SAU 1.125% 15 - 24.04.25	900 000	EUR	886 048	875 304	0,02
Red Electrica Financiaciones SAU 1.25% 18 - 13.03.27	800 000	EUR	764 807	763 192	0,02
Santander Consumer Finance SA Zero Coupon 21 - 23.02.26	1 000 000	EUR	921 493	933 040	0,02
Santander Consumer Finance SA 0.375% 20 - 17.01.25	1 500 000	EUR	1 456 807	1 450 455	0,04
Santander Consumer Finance SA 0.50% 19 - 14.11.26	600 000	EUR	565 724	554 844	0,01
Santander Consumer Finance SA 0.50% 22 - 14.01.27	1 200 000	EUR	1 092 514	1 103 868	0,03
Santander Consumer Finance SA 4.125% 23 - 05.05.28	600 000	EUR	596 223	619 830	0,02
Telefonica Emisiones SA 0.664% 20 - 03.02.30	1 600 000	EUR	1 429 728	1 382 592	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.201% 20 - 21.08.27	1 900 000	EUR	1 815 869	1 773 308	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.447% 18 - 22.01.27	1 500 000	EUR	1 436 154	1 430 820	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.46% 16 - 13.04.26	1 600 000	EUR	1 569 249	1 544 176	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.495% 18 - 11.09.25	1 400 000	EUR	1 365 228	1 360 464	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.528% 17 - 17.01.25	1 400 000	EUR	1 392 249	1 369 774	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.715% 17 - 12.01.28	2 100 000	EUR	2 023 266	1 986 474	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.788% 19 - 12.03.29	1 100 000	EUR	1 029 414	1 035 683	0,03
Telefonica Emisiones SA 1.807% 20 - 21.05.32	900 000	EUR	821 240	807 894	0,02
Telefonica Emisiones SA 1.864% 20 - 13.07.40	900 000	EUR	692 158	702 369	0,02
Telefonica Emisiones SA 1.93% 16 - 17.10.31	1 200 000	EUR	1 085 147	1 096 008	0,03
Telefonica Emisiones SA 1.957% 19 - 01.07.39	900 000	EUR	693 769	721 611	0,02
Telefonica Emisiones SA 2.318% 17 - 17.10.28	1 000 000	EUR	985 296	963 850	0,02
Telefonica Emisiones SA 2.592% 22 - 25.05.31	1 500 000	EUR	1 416 501	1 441 305	0,04
Telefonica Emisiones SA 2.932% 14 - 17.10.29	1 100 000	EUR	1 110 178	1 088 142	0,03
Telefonica Emisiones SA 4.183% 23 - 21.11.33	1 200 000	EUR	1 218 408	1 260 972	0,03
Unicaja Banco SA FRN 21 - 01.12.26	800 000	EUR	753 559	755 840	0,02
Unicaja Banco SA FRN 23 - 21.02.29	1 000 000	EUR	977 275	1 026 810	0,03
Werfen SA 4.625% 23 - 06.06.28	600 000	EUR	596 481	611 376	0,02
Werfenlife SA 0.50% 21 - 28.10.26	500 000	EUR	452 105	458 810	0,01
			198 865 794	201 171 130	5,20
Suède					
Akelius Residential Property AB 1.75% 17 - 07.02.25	1 000 000	EUR	978 987	969 470	0,02
Alfa Laval Treasury International AB 0.875% 22 - 18.02.26	600 000	EUR	567 722	573 246	0,01
Alfa Laval Treasury International AB 1.375% 22 - 18.02.29	300 000	EUR	265 867	274 884	0,01
Assa Abloy AB 3.75% 23 - 13.09.26	710 000	EUR	708 801	723 348	0,02
Assa Abloy AB 3.875% 23 - 13.09.30	990 000	EUR	984 463	1 039 530	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Assa Abloy AB 4.125% 23 - 13.09.35	790 000	EUR	783 081	866 646	0,02
Atlas Copco AB 0.625% 16 - 30.08.26	700 000	EUR	662 238	660 534	0,02
Castellum AB 0.75% 19 - 04.09.26	400 000	EUR	344 181	362 100	0,01
Electrolux AB 2.50% 22 - 18.05.30	700 000	EUR	638 865	642 866	0,02
Electrolux AB 4.125% 22 - 05.10.26	900 000	EUR	903 012	913 635	0,02
Electrolux AB 4.50% 23 - 29.09.28	500 000	EUR	501 263	511 570	0,01
Energa Finance AB 2.125% 17 - 07.03.27	300 000	EUR	282 073	285 246	0,01
EQT AB 0.875% 21 - 14.05.31	740 000	EUR	559 407	587 264	0,02
EQT AB 2.375% 22 - 06.04.28	1 000 000	EUR	936 062	943 540	0,02
EQT AB 2.875% 22 - 06.04.32	1 115 000	EUR	971 994	991 491	0,03
Essity AB 0.25% 21 - 08.02.31	920 000	EUR	743 625	783 638	0,02
Essity AB 0.50% 20 - 03.02.30	600 000	EUR	516 926	526 056	0,01
Essity AB 1.125% 15 - 05.03.25	400 000	EUR	388 311	388 652	0,01
Essity AB 1.625% 17 - 30.03.27	900 000	EUR	856 653	861 606	0,02
Fastighets AB Balder 1.125% 19 - 29.01.27	850 000	EUR	710 866	728 017	0,02
Fastighets AB Balder 1.25% 20 - 28.01.28	474 000	EUR	384 292	385 869	0,01
Fastighets AB Balder 1.875% 17 - 14.03.25	900 000	EUR	848 123	859 554	0,02
Fastighets AB Balder 1.875% 17 - 23.01.26	500 000	EUR	444 731	455 925	0,01
Heimstaden Bostad AB 1.125% 20 - 21.01.26	570 000	EUR	505 456	487 196	0,01
Hemso Fastighets AB 1.00% 16 - 09.09.26	492 000	EUR	453 015	455 764	0,01
Investor AB 0.375% 20 - 29.10.35	934 000	EUR	687 490	676 552	0,02
Investor AB 1.50% 18 - 12.09.30	700 000	EUR	645 964	636 832	0,02
Investor AB 1.50% 19 - 20.06.39	770 000	EUR	608 754	585 015	0,02
Investor AB 2.75% 22 - 10.06.32	1 000 000	EUR	954 152	971 360	0,02
Lansforsakringar Bank AB 0.05% 21 - 15.04.26	600 000	EUR	565 186	554 568	0,01
Lansforsakringar Bank AB 0.125% 20 - 19.02.25	987 000	EUR	948 719	947 007	0,02
Lansforsakringar Bank AB 4.00% 23 - 18.01.27	702 000	EUR	698 990	713 653	0,02
Molnlycke Holding AB 4.25% 23 - 08.09.28	800 000	EUR	796 400	821 352	0,02
Molnlycke Holdings AB 0.625% 20 - 15.01.31	600 000	EUR	483 421	485 076	0,01
Molnlycke Holdings AB 0.875% 19 - 05.09.29	765 000	EUR	660 912	658 734	0,02
Molnlycke Holdings AB 1.875% 17 - 28.02.25	550 000	EUR	541 895	537 163	0,01
Nordea Bank Abp FRN 21 - 18.08.31	1 539 000	EUR	1 399 061	1 414 464	0,04
Sagax AB 1.125% 20 - 30.01.27	454 000	EUR	399 569	408 323	0,01
Sagax AB 2.25% 19 - 13.03.25	614 000	EUR	597 703	597 207	0,02
Sandvik AB 0.375% 21 - 25.11.28	800 000	EUR	692 332	703 888	0,02
Sandvik AB 2.125% 22 - 07.06.27	1 000 000	EUR	953 981	969 780	0,02
Sandvik AB 3.00% 14 - 18.06.26	300 000	EUR	300 616	297 099	0,01
Sandvik AB 3.75% 22 - 27.09.29	700 000	EUR	695 474	723 870	0,02
Scania CV AB 2.25% 20 - 03.06.25	910 000	EUR	890 376	891 254	0,02
Securitas AB 0.25% 21 - 22.02.28	592 000	EUR	501 466	521 635	0,01
Securitas AB 1.25% 18 - 06.03.25	300 000	EUR	290 340	290 433	0,01
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.375% 20 - 11.02.27	1 195 000	EUR	1 103 314	1 089 219	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.375% 21 - 21.06.28	1 630 000	EUR	1 408 709	1 424 962	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.625% 19 - 12.11.29	1 316 000	EUR	1 131 027	1 122 482	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 21 - 03.11.31	730 000	EUR	642 803	664 483	0,02
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.75% 22 - 09.08.27	1 521 000	EUR	1 393 374	1 383 623	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.75% 22 - 11.11.26	1 153 000	EUR	1 108 335	1 107 272	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.25% 22 - 24.11.25	1 609 000	EUR	1 595 471	1 610 175	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.75% 23 - 07.02.28	1 600 000	EUR	1 586 541	1 617 632	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.875% 23 - 09.05.28	1 500 000	EUR	1 499 210	1 536 180	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.00% 22 - 09.11.26	1 609 000	EUR	1 613 264	1 637 125	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.125% 23 - 29.06.27	1 800 000	EUR	1 801 566	1 854 036	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.375% 23 - 06.11.28	700 000	EUR	705 020	726 194	0,02
Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 23 - 17.08.33	800 000	EUR	794 935	831 600	0,02
SKF AB 0.25% 21 - 15.02.31	494 000	EUR	391 120	393 308	0,01
SKF AB 0.875% 19 - 15.11.29	430 000	EUR	369 771	376 250	0,01
SKF AB 1.25% 18 - 17.09.25	435 000	EUR	418 747	419 962	0,01
SKF AB 3.125% 22 - 14.09.28	700 000	EUR	675 918	700 028	0,02
Svenska Handelsbanken AB 0.01% 20 - 02.12.27	1 060 000	EUR	948 844	937 708	0,02
Svenska Handelsbanken AB 0.05% 19 - 03.09.26	800 000	EUR	761 901	735 792	0,02
Svenska Handelsbanken AB 0.05% 21 - 06.09.28	1 600 000	EUR	1 384 454	1 392 368	0,04
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 21 - 03.11.26	1 509 000	EUR	1 397 377	1 386 771	0,04
Svenska Handelsbanken AB 0.50% 20 - 18.02.30	1 100 000	EUR	932 167	931 502	0,02
Svenska Handelsbanken AB 1.00% 20 - 15.04.25	1 943 000	EUR	1 899 118	1 885 273	0,05
Svenska Handelsbanken AB 1.375% 22 - 23.02.29	1 542 000	EUR	1 406 074	1 408 262	0,04
Svenska Handelsbanken AB 2.625% 22 - 05.09.29	1 200 000	EUR	1 147 513	1 172 100	0,03
Svenska Handelsbanken AB FRN 22 - 01.06.33	750 000	EUR	705 868	731 242	0,02
Svenska Handelsbanken AB 3.375% 23 - 17.02.28	1 450 000	EUR	1 429 601	1 463 369	0,04
Svenska Handelsbanken AB 3.75% 22 - 01.11.27	1 200 000	EUR	1 200 103	1 231 260	0,03
Svenska Handelsbanken AB 3.75% 23 - 05.05.26	2 000 000	EUR	1 993 400	2 025 360	0,05
Svenska Handelsbanken AB 3.875% 23 - 10.05.27	1 110 000	EUR	1 115 361	1 132 699	0,03
Svenska Handelsbanken AB FRN 23 - 16.08.34	1 200 000	EUR	1 190 777	1 257 972	0,03
Swedbank AB 0.20% 21 - 12.01.28	1 270 000	EUR	1 117 032	1 107 161	0,03
Swedbank AB 0.25% 21 - 02.11.26	1 200 000	EUR	1 130 937	1 107 360	0,03
Swedbank AB FRN 21 - 20.05.27	1 706 000	EUR	1 591 610	1 576 037	0,04
Swedbank AB 0.75% 20 - 05.05.25	1 400 000	EUR	1 361 913	1 349 628	0,03
Swedbank AB 1.30% 22 - 17.02.27	1 316 000	EUR	1 216 538	1 225 104	0,03
Swedbank AB 2.10% 22 - 25.05.27	1 353 000	EUR	1 311 607	1 302 303	0,03
Swedbank AB FRN 22 - 23.08.32	1 000 000	EUR	948 505	977 570	0,03
Swedbank AB 3.75% 22 - 14.11.25	1 509 000	EUR	1 508 849	1 521 872	0,04
Swedbank AB 4.125% 23 - 13.11.28	1 500 000	EUR	1 527 810	1 554 015	0,04
Swedbank AB 4.25% 23 - 11.07.28	900 000	EUR	902 133	924 642	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Swedbank AB 4.375% 23 - 05.09.30	980 000	EUR	967 208	1 015 839	0,03
Swedbank AB 4.625% 23 - 30.05.26	1 200 000	EUR	1 199 534	1 212 588	0,03
Swedish Match AB 0.875% 20 - 26.02.27	500 000	EUR	456 232	460 925	0,01
Swedish Match AB 1.20% 17 - 10.11.25	700 000	EUR	667 652	669 130	0,02
Tele2 AB 0.75% 21 - 23.03.31	400 000	EUR	317 294	334 388	0,01
Tele2 AB 2.125% 18 - 15.05.28	1 033 000	EUR	968 088	989 025	0,03
Tele2 AB 3.75% 23 - 22.11.29	600 000	EUR	594 524	615 780	0,02
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.00% 21 - 26.05.29	800 000	EUR	654 018	677 776	0,02
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.125% 22 - 08.02.27	1 066 000	EUR	967 946	984 909	0,03
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 5.375% 23 - 29.05.28	950 000	EUR	978 589	992 740	0,03
Telia Co. AB 0.125% 20 - 27.11.30	695 000	EUR	568 896	568 322	0,01
Telia Co. AB FRN 20 - 11.05.81	705 000	EUR	637 592	654 769	0,02
Telia Co. AB 1.625% 15 - 23.02.35	667 000	EUR	565 020	563 782	0,01
Telia Co. AB 2.125% 19 - 20.02.34	779 000	EUR	702 354	702 635	0,02
Telia Co. AB FRN 22 - 30.06.83	879 000	EUR	785 774	808 689	0,02
Telia Co. AB 3.00% 12 - 07.09.27	832 000	EUR	849 495	834 280	0,02
Telia Co. AB 3.50% 13 - 05.09.33	700 000	EUR	709 820	717 906	0,02
Telia Co. AB 3.625% 23 - 22.02.32	870 000	EUR	860 057	900 554	0,02
Telia Co. AB 3.875% 10 - 01.10.25	959 000	EUR	980 245	970 249	0,02
Telia Co. AB FRN 22 - 21.12.82	880 000	EUR	851 835	877 738	0,02
Volvo Treasury AB Zero Coupon 21 - 18.05.26	800 000	EUR	737 551	743 688	0,02
Volvo Treasury AB 0.625% 22 - 14.02.25	710 000	EUR	692 320	687 145	0,02
Volvo Treasury AB 1.625% 20 - 26.05.25	717 000	EUR	706 707	699 362	0,02
Volvo Treasury AB 1.625% 22 - 18.09.25	676 000	EUR	661 714	656 849	0,02
Volvo Treasury AB 2.00% 22 - 19.08.27	600 000	EUR	571 283	579 408	0,01
Volvo Treasury AB 2.625% 22 - 20.02.26	1 080 000	EUR	1 062 670	1 067 386	0,03
Volvo Treasury AB 3.50% 23 - 17.11.25	1 099 000	EUR	1 092 102	1 103 671	0,03
Volvo Treasury AB 3.625% 23 - 25.05.27	900 000	EUR	896 884	915 489	0,02
Volvo Treasury AB 3.875% 23 - 29.08.26	1 100 000	EUR	1 100 972	1 120 801	0,03
			101 425 808	102 640 636	2,66
Suisse					
Credit Suisse AG 0.25% 21 - 05.01.26	1 984 000	EUR	1 855 636	1 861 726	0,05
Credit Suisse AG 0.25% 21 - 01.09.28	1 800 000	EUR	1 539 168	1 565 406	0,04
Credit Suisse AG 0.45% 20 - 19.05.25	562 000	EUR	535 462	539 514	0,01
Credit Suisse AG 1.50% 16 - 10.04.26	2 060 000	EUR	1 984 623	1 972 574	0,05
Credit Suisse AG 5.50% 23 - 20.08.26	1 300 000	EUR	1 314 326	1 366 196	0,04
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 4.84% 23 - 03.11.28	900 000	EUR	907 642	938 745	0,02
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 5.23% 22 - 01.11.27	1 000 000	EUR	1 028 127	1 060 100	0,03
UBS AG 0.01% 21 - 31.03.26	2 400 000	EUR	2 266 962	2 235 552	0,06
UBS AG 0.01% 21 - 29.06.26	700 000	EUR	649 160	648 144	0,02
UBS AG 0.50% 21 - 31.03.31	1 400 000	EUR	1 143 000	1 144 724	0,03
UBS Group AG FRN 20 - 29.01.26	2 171 000	EUR	2 094 128	2 080 665	0,05
UBS Group AG FRN 20 - 05.11.28	2 235 000	EUR	1 942 334	1 966 666	0,05
UBS Group AG 0.25% 21 - 24.02.28	1 500 000	EUR	1 307 453	1 319 415	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Group AG FRN 21 - 03.11.26	1 800 000	EUR	1 692 843	1 688 418	0,04
UBS Group AG 0.625% 21 - 18.01.33	2 397 000	EUR	1 795 918	1 808 345	0,05
UBS Group AG 0.625% 21 - 24.02.33	1 881 000	EUR	1 492 833	1 442 614	0,04
UBS Group AG 0.65% 19 - 10.09.29	1 300 000	EUR	1 040 223	1 106 391	0,03
UBS Group AG FRN 20 - 14.01.28	2 001 000	EUR	1 785 979	1 828 734	0,05
UBS Group AG 0.875% 21 - 03.11.31	1 962 000	EUR	1 598 431	1 583 216	0,04
UBS Group AG FRN 19 - 24.06.27	2 237 000	EUR	2 054 400	2 100 073	0,05
UBS Group AG 1.25% 16 - 01.09.26	1 855 000	EUR	1 787 962	1 763 586	0,05
UBS Group AG FRN 22 - 13.10.26	3 314 000	EUR	3 148 671	3 219 783	0,08
UBS Group AG FRN 22 - 15.06.27	1 400 000	EUR	1 354 430	1 371 650	0,04
UBS Group AG FRN 22 - 02.04.32	2 236 000	EUR	1 989 373	2 088 871	0,05
UBS Group AG FRN 22 - 15.06.30	1 300 000	EUR	1 236 336	1 264 575	0,03
UBS Group AG FRN 20 - 02.04.26	2 927 000	EUR	2 893 018	2 900 950	0,08
UBS Group AG FRN 23 - 11.01.31	1 604 000	EUR	1 601 763	1 654 702	0,04
UBS Group AG FRN 23 - 17.03.28	1 960 000	EUR	1 955 670	2 015 821	0,05
UBS Group AG FRN 23 - 17.03.32	1 440 000	EUR	1 440 545	1 517 141	0,04
UBS Group AG FRN 22 - 01.03.29	4 527 000	EUR	4 680 319	5 216 824	0,14
			52 116 735	53 271 121	1,38
Royaume-Uni					
3i Group PLC 4.875% 23 - 14.06.29	600 000	EUR	593 078	627 078	0,02
Amcor UK Finance PLC 1.125% 20 - 23.06.27	568 000	EUR	522 808	529 007	0,01
Anglo American Capital PLC 1.625% 17 - 18.09.25	950 000	EUR	921 349	921 823	0,02
Anglo American Capital PLC 1.625% 19 - 11.03.26	1 003 000	EUR	965 536	964 495	0,02
Anglo American Capital PLC 4.50% 23 - 15.09.28	890 000	EUR	900 141	924 603	0,02
Anglo American Capital PLC 4.75% 22 - 21.09.32	1 100 000	EUR	1 085 782	1 155 748	0,03
Anglo American Capital PLC 5.00% 23 - 15.03.31	800 000	EUR	804 186	852 040	0,02
Aon Global Ltd. 2.875% 14 - 14.05.26	600 000	EUR	586 784	590 160	0,02
AstraZeneca PLC 0.375% 21 - 03.06.29	1 531 000	EUR	1 358 911	1 347 050	0,03
AstraZeneca PLC 1.25% 16 - 12.05.28	1 200 000	EUR	1 140 183	1 128 948	0,03
AstraZeneca PLC 3.625% 23 - 03.03.27	1 200 000	EUR	1 200 863	1 227 612	0,03
AstraZeneca PLC 3.75% 23 - 03.03.32	980 000	EUR	986 139	1 031 646	0,03
Aviva PLC 1.875% 18 - 13.11.27	600 000	EUR	649 395	585 672	0,02
Aviva PLC 1.875% 18 - 13.11.27	100 000	EUR	97 263	97 612	0,00
Aviva PLC FRN 15 - 04.12.45	1 300 000	EUR	1 279 629	1 267 461	0,03
Babcock International Group PLC 1.375% 19 - 13.09.27	721 000	EUR	649 397	663 630	0,02
Barclays PLC FRN 21 - 09.08.29	2 200 000	EUR	1 911 690	1 893 650	0,05
Barclays PLC FRN 22 - 28.01.28	2 100 000	EUR	1 914 946	1 927 779	0,05
Barclays PLC FRN 21 - 12.05.32	1 800 000	EUR	1 452 866	1 467 540	0,04
Barclays PLC FRN 21 - 22.03.31	1 500 000	EUR	1 355 391	1 382 055	0,04
Barclays PLC FRN 18 - 24.01.26	1 527 000	EUR	1 478 720	1 483 083	0,04
Barclays PLC FRN 22 - 31.01.27	1 600 000	EUR	1 553 800	1 573 264	0,04
Barclays PLC FRN 23 - 08.08.30	1 700 000	EUR	1 697 972	1 772 080	0,05
Barclays PLC FRN 22 - 29.01.34	1 911 000	EUR	1 918 917	2 045 993	0,05
BAT International Finance PLC 1.25% 15 - 13.03.27	1 000 000	EUR	948 764	929 860	0,02
BAT International Finance PLC 2.00% 15 - 13.03.45	900 000	EUR	585 069	571 518	0,01
BAT International Finance PLC 2.25% 17 - 16.01.30	1 823 000	EUR	1 646 941	1 622 288	0,04
BAT International Finance PLC 2.75% 13 - 25.03.25	1 110 000	EUR	1 099 841	1 095 215	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
BAT International Finance PLC 3.125% 14 - 06.03.29	909 000	EUR	858 566	879 957	0,02
BG Energy Capital PLC 2.25% 14 - 21.11.29	1 028 000	EUR	966 545	976 117	0,03
BP Capital Markets PLC 0.831% 19 - 08.11.27	700 000	EUR	628 964	647 332	0,02
BP Capital Markets PLC 1.077% 17 - 26.06.25	500 000	EUR	481 719	483 275	0,01
BP Capital Markets PLC 1.104% 19 - 15.11.34	1 259 000	EUR	1 008 575	993 729	0,03
BP Capital Markets PLC 1.231% 19 - 08.05.31	1 755 000	EUR	1 535 721	1 532 045	0,04
BP Capital Markets PLC 1.573% 15 - 16.02.27	1 300 000	EUR	1 224 445	1 241 058	0,03
BP Capital Markets PLC 1.594% 18 - 03.07.28	1 000 000	EUR	955 623	939 440	0,02
BP Capital Markets PLC 1.637% 17 - 26.06.29	1 000 000	EUR	906 739	928 580	0,02
BP Capital Markets PLC 1.953% 16 - 03.03.25	800 000	EUR	784 412	785 664	0,02
BP Capital Markets PLC 2.213% 14 - 25.09.26	1 127 000	EUR	1 108 492	1 102 195	0,03
BP Capital Markets PLC 2.519% 20 - 07.04.28	1 506 000	EUR	1 468 986	1 478 395	0,04
BP Capital Markets PLC 2.822% 20 - 07.04.32	1 800 000	EUR	1 745 826	1 749 744	0,05
BP Capital Markets PLC 2.972% 14 - 27.02.26	1 000 000	EUR	987 250	993 880	0,03
BP Capital Markets PLC FRN 20 - 31.12.99	3 752 000	EUR	3 624 405	3 622 856	0,09
BP Capital Markets PLC FRN 20 - 31.12.99	3 338 000	EUR	3 101 019	3 124 802	0,08
Brambles Finance PLC 1.50% 17 - 04.10.27	900 000	EUR	845 639	848 043	0,02
Brambles Finance PLC 4.25% 23 - 22.03.31	680 000	EUR	685 291	717 067	0,02
British Telecommunications PLC 0.50% 19 - 12.09.25	1 300 000	EUR	1 236 089	1 238 445	0,03
British Telecommunications PLC 1.125% 19 - 12.09.29	1 050 000	EUR	926 084	942 196	0,02
British Telecommunications PLC 1.50% 17 - 23.06.27	1 800 000	EUR	1 712 082	1 702 404	0,04
British Telecommunications PLC 1.75% 16 - 10.03.26	1 740 000	EUR	1 703 657	1 687 713	0,04
British Telecommunications PLC 2.125% 18 - 26.09.28	701 000	EUR	653 436	671 866	0,02
British Telecommunications PLC 2.75% 22 - 30.08.27	900 000	EUR	874 439	889 344	0,02
British Telecommunications PLC 3.375% 22 - 30.08.32	700 000	EUR	670 933	700 056	0,02
British Telecommunications PLC 3.75% 23 - 13.05.31	1 300 000	EUR	1 265 671	1 336 491	0,03
British Telecommunications PLC 4.25% 23 - 06.01.33	1 260 000	EUR	1 240 247	1 326 906	0,03
BUPA Finance PLC 5.00% 23 - 12.10.30	700 000	EUR	704 532	751 982	0,02
Cadent Finance PLC 0.625% 21 - 19.03.30	800 000	EUR	676 661	673 744	0,02
Cadent Finance PLC 0.75% 20 - 11.03.32	927 000	EUR	734 548	747 978	0,02
Cadent Finance PLC 4.25% 23 - 05.07.29	790 000	EUR	785 511	824 752	0,02
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0.20% 20 - 02.12.28	1 010 000	EUR	904 625	881 346	0,02
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0.70% 19 - 12.09.31	700 000	EUR	568 763	585 774	0,02
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.125% 19 - 12.04.29	1 000 000	EUR	885 331	907 010	0,02
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.50% 18 - 08.11.27	1 324 000	EUR	1 268 102	1 251 034	0,03
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.75% 16 - 26.05.28	600 000	EUR	557 510	569 670	0,01
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.75% 20 - 27.03.26	755 000	EUR	739 634	734 026	0,02
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.875% 15 - 18.03.30	500 000	EUR	476 091	463 555	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Coca-Cola Europacific Partners PLC 2.375% 13 - 07.05.25	630 000	EUR	621 418	621 438	0,02
Diageo Finance PLC 1.00% 18 - 22.04.25	944 000	EUR	923 533	915 246	0,02
Diageo Finance PLC 1.50% 18 - 22.10.27	731 000	EUR	694 493	694 326	0,02
Diageo Finance PLC 1.875% 20 - 27.03.27	1 268 000	EUR	1 237 124	1 227 272	0,03
Diageo Finance PLC 2.375% 14 - 20.05.26	1 090 000	EUR	1 082 753	1 063 971	0,03
Diageo Finance PLC 2.50% 20 - 27.03.32	1 556 000	EUR	1 528 143	1 491 815	0,04
Diageo Finance PLC 3.50% 23 - 26.06.25	800 000	EUR	795 491	801 440	0,02
DS Smith PLC 0.875% 19 - 12.09.26	859 000	EUR	797 811	801 438	0,02
DS Smith PLC 4.375% 23 - 27.07.27	1 420 000	EUR	1 419 749	1 461 208	0,04
DS Smith PLC 4.50% 23 - 27.07.30	910 000	EUR	899 372	948 029	0,02
easyJet PLC 0.875% 19 - 11.06.25	700 000	EUR	671 601	672 812	0,02
Experian Finance PLC 1.375% 17 - 25.06.26	1 100 000	EUR	1 050 446	1 051 974	0,03
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.00% 17 - 12.09.26	1 034 000	EUR	1 000 224	985 805	0,03
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.25% 18 - 21.05.26	1 498 000	EUR	1 456 866	1 441 241	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 17 - 12.09.29	375 000	EUR	341 777	347 437	0,01
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 17 - 12.09.29	200 000	EUR	189 194	185 300	0,00
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.75% 18 - 21.05.30	900 000	EUR	855 783	843 039	0,02
GlaxoSmithKline Capital PLC 4.00% 05 - 16.06.25	1 100 000	EUR	1 126 095	1 110 703	0,03
HBOS PLC FRN 05 - 18.03.30	600 000	EUR	597 611	597 996	0,02
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 13.11.26	1 548 000	EUR	1 451 997	1 458 541	0,04
HSBC Holdings PLC FRN 21 - 24.09.29	1 600 000	EUR	1 370 808	1 403 696	0,04
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 13.11.31	1 225 000	EUR	1 012 691	1 026 783	0,03
HSBC Holdings PLC 2.50% 16 - 15.03.27	1 700 000	EUR	1 683 147	1 667 411	0,04
HSBC Holdings PLC 3.00% 15 - 30.06.25	2 100 000	EUR	2 090 736	2 078 286	0,05
HSBC Holdings PLC FRN 22 - 15.06.27	2 900 000	EUR	2 831 720	2 864 446	0,07
HSBC Holdings PLC 3.125% 16 - 07.06.28	1 281 000	EUR	1 243 362	1 259 479	0,03
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 10.03.28	2 330 000	EUR	2 350 020	2 416 583	0,06
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 10.03.32	2 060 000	EUR	2 077 003	2 178 017	0,06
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 23.05.33	2 500 000	EUR	2 520 092	2 650 400	0,07
HSBC Holdings PLC FRN 22 - 16.11.32	2 011 000	EUR	2 066 205	2 163 937	0,06
Imperial Brands Finance PLC 1.375% 17 - 27.01.25	600 000	EUR	586 029	583 668	0,01
Imperial Brands Finance PLC 2.125% 19 - 12.02.27	1 090 000	EUR	1 051 631	1 050 978	0,03
Imperial Brands Finance PLC 3.375% 14 - 26.02.26	810 000	EUR	809 112	802 621	0,02
Informa PLC 1.25% 19 - 22.04.28	799 000	EUR	722 314	731 716	0,02
Informa PLC 2.125% 20 - 06.10.25	1 090 000	EUR	1 058 073	1 059 131	0,03
InterContinental Hotels Group PLC 2.125% 18 - 15.05.27	600 000	EUR	575 279	578 418	0,01
Intermediate Capital Group PLC 1.625% 20 - 17.02.27	814 000	EUR	722 748	751 086	0,02
Intermediate Capital Group PLC 2.50% 22 - 28.01.30	729 000	EUR	612 952	641 979	0,02
International Distributions Services PLC 1.25% 19 - 08.10.26	421 000	EUR	400 180	393 189	0,01
International Distributions Services PLC 1.25% 19 - 08.10.26	179 000	EUR	168 139	167 175	0,00
International Distributions Services PLC 5.25% 23 - 14.09.28	960 000	EUR	956 203	996 365	0,03
Investec Bank PLC FRN 21 - 17.02.27	336 000	EUR	301 460	307 114	0,01
Investec Bank PLC FRN 22 - 11.08.26	520 000	EUR	485 910	487 698	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
ITV PLC 1.375% 19 - 26.09.26	700 000	EUR	654 405	658 693	0,02
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 0.375% 20 - 28.01.25	1 010 000	EUR	981 377	974 943	0,03
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 2.375% 20 - 09.04.26	1 757 000	EUR	1 723 780	1 725 620	0,04
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 4.125% 23 - 30.05.27	1 400 000	EUR	1 396 749	1 433 096	0,04
Lloyds Bank PLC 1.25% 15 - 13.01.25	1 200 000	EUR	1 184 909	1 168 836	0,03
Lloyds Banking Group PLC 1.50% 17 - 12.09.27	1 155 000	EUR	1 112 709	1 091 279	0,03
Lloyds Banking Group PLC FRN 22 - 24.08.30	1 500 000	EUR	1 404 533	1 459 935	0,04
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 01.04.26	2 100 000	EUR	2 114 967	2 093 679	0,05
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 18.03.30	400 000	EUR	391 743	398 968	0,01
Lloyds Banking Group PLC FRN 23 - 11.01.29	1 353 000	EUR	1 354 553	1 405 226	0,04
Lloyds Banking Group PLC FRN 23 - 21.09.31	1 890 000	EUR	1 868 429	1 996 898	0,05
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 17 - 19.09.29	851 000	EUR	795 975	795 634	0,02
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 18 - 06.12.27	930 000	EUR	903 817	890 652	0,02
Marex Group PLC 8.375% 23 - 02.02.28	400 000	EUR	403 513	421 188	0,01
Mitsubishi HC Capital UK PLC 0.25% 22 - 03.02.25	500 000	EUR	481 233	479 155	0,01
Mobico Group PLC 4.875% 23 - 26.09.31	800 000	EUR	779 027	813 072	0,02
Mondi Finance PLC 1.625% 18 - 27.04.26	868 000	EUR	831 414	837 915	0,02
Motability Operations Group PLC 0.125% 21 - 20.07.28	563 000	EUR	499 903	495 412	0,01
Motability Operations Group PLC 0.375% 19 - 03.01.26	1 121 000	EUR	1 066 576	1 060 421	0,03
Motability Operations Group PLC 0.875% 17 - 14.03.25	703 000	EUR	688 194	682 276	0,02
Motability Operations Group PLC 3.50% 23 - 17.07.31	700 000	EUR	680 021	717 640	0,02
National Gas Transmission PLC 4.25% 23 - 05.04.30	710 000	EUR	708 763	736 895	0,02
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC 3.53% 22 - 20.09.28	800 000	EUR	783 288	812 536	0,02
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC 3.949% 22 - 20.09.32	700 000	EUR	688 422	720 034	0,02
National Grid Electricity Transmission PLC 0.19% 20 - 20.01.25	658 000	EUR	640 192	634 720	0,02
National Grid Electricity Transmission PLC 0.823% 20 - 07.07.32	1 309 000	EUR	1 079 915	1 062 031	0,03
National Grid Electricity Transmission PLC 0.872% 20 - 26.11.40	923 000	EUR	550 539	614 312	0,02
National Grid PLC 0.163% 21 - 20.01.28	700 000	EUR	622 582	620 081	0,02
National Grid PLC 0.25% 21 - 01.09.28	1 300 000	EUR	1 140 069	1 135 173	0,03
National Grid PLC 0.553% 20 - 18.09.29	940 000	EUR	785 207	808 090	0,02
National Grid PLC 0.75% 21 - 01.09.33	1 300 000	EUR	994 505	994 240	0,03
National Grid PLC 2.179% 22 - 30.06.26	919 000	EUR	897 826	893 479	0,02
National Grid PLC 2.949% 22 - 30.03.30	800 000	EUR	752 381	779 104	0,02
National Grid PLC 3.245% 22 - 30.03.34	1 167 000	EUR	1 092 565	1 108 848	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
National Grid PLC 3.875% 23 - 16.01.29	870 000	EUR	868 195	894 308	0,02
National Grid PLC 4.275% 23 - 16.01.35	1 440 000	EUR	1 424 222	1 490 314	0,04
Nationwide Building Society 0.25% 20 - 22.07.25	1 598 000	EUR	1 540 988	1 520 928	0,04
Nationwide Building Society 0.25% 21 - 14.09.28	1 100 000	EUR	945 201	960 025	0,02
Nationwide Building Society 1.25% 15 - 03.03.25	1 400 000	EUR	1 372 161	1 362 522	0,04
Nationwide Building Society FRN 18 - 08.03.26	1 165 000	EUR	1 140 744	1 133 848	0,03
Nationwide Building Society 2.00% 22 - 28.04.27	1 358 000	EUR	1 296 218	1 305 785	0,03
Nationwide Building Society 3.25% 22 - 05.09.29	1 200 000	EUR	1 170 808	1 197 972	0,03
Nationwide Building Society 4.50% 23 - 01.11.26	1 920 000	EUR	1 932 366	1 980 365	0,05
NatWest Group PLC FRN 21 - 14.09.29	1 500 000	EUR	1 316 971	1 302 675	0,03
NatWest Group PLC FRN 21 - 26.02.30	1 300 000	EUR	1 143 825	1 119 495	0,03
NatWest Group PLC FRN 21 - 14.09.32	1 136 000	EUR	979 499	1 003 588	0,03
NatWest Group PLC FRN 18 - 02.03.26	2 200 000	EUR	2 159 420	2 142 162	0,06
NatWest Group PLC FRN 22 - 06.09.28	1 200 000	EUR	1 185 534	1 221 984	0,03
NatWest Group PLC FRN 23 - 14.03.28	1 020 000	EUR	1 022 594	1 049 580	0,03
NatWest Group PLC FRN 23 - 16.02.29	1 460 000	EUR	1 462 939	1 518 269	0,04
NatWest Group PLC FRN 23 - 28.02.34	1 120 000	EUR	1 111 699	1 178 341	0,03
NatWest Markets PLC 0.125% 21 - 18.06.26	1 804 000	EUR	1 687 578	1 671 677	0,04
NatWest Markets PLC 0.125% 21 - 12.11.25	1 653 000	EUR	1 558 959	1 557 258	0,04
NatWest Markets PLC 1.375% 22 - 02.03.27	1 321 000	EUR	1 252 985	1 243 272	0,03
NatWest Markets PLC 2.00% 22 - 27.08.25	1 114 000	EUR	1 086 614	1 086 295	0,03
NatWest Markets PLC 2.75% 20 - 02.04.25	1 566 000	EUR	1 562 654	1 551 514	0,04
NatWest Markets PLC 4.25% 23 - 13.01.28	1 300 000	EUR	1 303 361	1 343 693	0,03
Omnicom Finance Holdings PLC 0.80% 19 - 08.07.27	803 000	EUR	738 416	741 916	0,02
Omnicom Finance Holdings PLC 1.40% 19 - 08.07.31	700 000	EUR	595 579	626 920	0,02
OTE PLC 0.875% 19 - 24.09.26	517 000	EUR	486 153	485 292	0,01
Pearson Funding PLC 1.375% 15 - 06.05.25	300 000	EUR	291 081	289 752	0,01
Phoenix Group Holdings PLC 4.375% 18 - 24.01.29	764 000	EUR	733 321	730 850	0,02
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 3.625% 23 - 14.09.28	1 200 000	EUR	1 188 971	1 240 980	0,03
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 3.875% 23 - 14.09.33	1 200 000	EUR	1 175 821	1 270 476	0,03
Rentokil Initial PLC 0.50% 20 - 14.10.28	930 000	EUR	810 756	823 813	0,02
Rentokil Initial PLC 0.875% 19 - 30.05.26	745 000	EUR	705 566	705 038	0,02
Sage Group PLC 3.82% 23 - 15.02.28	700 000	EUR	697 288	719 936	0,02
Santander UK Group Holdings PLC FRN 21 - 13.09.29	1 400 000	EUR	1 179 365	1 204 280	0,03
Santander UK Group Holdings PLC FRN 22 - 25.08.28	1 100 000	EUR	1 067 184	1 091 849	0,03
Santander UK PLC 1.125% 15 - 10.03.25	1 000 000	EUR	970 598	969 600	0,02
Sky Ltd. 2.25% 15 - 17.11.25	946 000	EUR	920 160	930 041	0,02
Sky Ltd. 2.50% 14 - 15.09.26	1 536 000	EUR	1 542 064	1 513 298	0,04
Sky Ltd. 2.75% 14 - 27.11.29	600 000	EUR	617 827	605 250	0,02
Smith & Nephew PLC 4.565% 22 - 11.10.29	800 000	EUR	807 585	848 544	0,02
Smiths Group PLC 2.00% 17 - 23.02.27	869 000	EUR	835 980	842 139	0,02
SSE PLC 0.875% 17 - 06.09.25	800 000	EUR	776 780	768 432	0,02
SSE PLC 1.25% 20 - 16.04.25	678 000	EUR	663 381	658 250	0,02
SSE PLC 1.375% 18 - 04.09.27	1 310 000	EUR	1 236 798	1 238 055	0,03

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
SSE PLC 1.75% 20 - 16.04.30	800 000	EUR	700 816	733 736	0,02
SSE PLC 2.875% 22 - 01.08.29	1 210 000	EUR	1 173 186	1 196 775	0,03
SSE PLC FRN 20 - 31.12.99	673 000	EUR	624 249	638 011	0,02
SSE PLC FRN 22 - 31.12.99	1 453 000	EUR	1 363 804	1 409 018	0,04
SSE PLC 4.00% 23 - 05.09.31	860 000	EUR	859 332	898 984	0,02
Standard Chartered PLC FRN 21 - 17.11.29	900 000	EUR	773 228	783 126	0,02
Standard Chartered PLC FRN 20 - 27.01.28	892 000	EUR	821 693	817 134	0,02
Standard Chartered PLC FRN 19 - 02.07.27	933 000	EUR	863 511	871 721	0,02
Standard Chartered PLC FRN 21 - 23.09.31	1 302 000	EUR	1 160 978	1 181 044	0,03
Standard Chartered PLC FRN 17 - 03.10.27	577 000	EUR	555 102	546 961	0,01
Standard Chartered PLC FRN 20 - 09.09.30	1 811 000	EUR	1 751 192	1 752 794	0,05
Standard Chartered PLC FRN 23 - 10.05.31	1 500 000	EUR	1 502 111	1 569 720	0,04
Swiss Re Finance UK PLC FRN 20 - 04.06.52	1 100 000	EUR	941 668	975 183	0,03
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0.375% 21 - 27.07.29	1 421 000	EUR	1 184 813	1 207 438	0,03
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0.875% 19 - 29.05.26	947 000	EUR	898 227	896 979	0,02
Tesco Corporate Treasury Services PLC 4.25% 23 - 27.02.31	670 000	EUR	665 649	696 177	0,02
Thames Water Utilities Finance PLC 0.875% 22 - 31.01.28	908 000	EUR	804 674	775 414	0,02
Thames Water Utilities Finance PLC 1.25% 22 - 31.01.32	808 000	EUR	648 551	607 769	0,02
Thames Water Utilities Finance PLC 4.00% 23 - 18.04.27	852 000	EUR	842 288	824 583	0,02
Thames Water Utilities Finance PLC 4.375% 23 - 18.01.31	1 604 000	EUR	1 545 762	1 513 775	0,04
Tritax EuroBox PLC 0.95% 21 - 02.06.26	898 000	EUR	802 822	816 884	0,02
Unilever PLC 1.50% 19 - 11.06.39	900 000	EUR	690 583	730 188	0,02
Virgin Money UK PLC FRN 23 - 29.10.28	770 000	EUR	742 460	768 160	0,02
Vodafone Group PLC 0.90% 19 - 24.11.26	1 200 000	EUR	1 151 937	1 137 672	0,03
Vodafone Group PLC 1.125% 17 - 20.11.25	1 483 000	EUR	1 560 745	1 427 610	0,04
Vodafone Group PLC 1.50% 17 - 24.07.27	850 000	EUR	803 507	811 231	0,02
Vodafone Group PLC 1.60% 16 - 29.07.31	1 614 000	EUR	1 458 743	1 446 144	0,04
Vodafone Group PLC 1.625% 19 - 24.11.30	1 624 000	EUR	1 518 373	1 472 919	0,04
Vodafone Group PLC 1.875% 14 - 11.09.25	1 500 000	EUR	1 486 583	1 462 125	0,04
Vodafone Group PLC 1.875% 17 - 20.11.29	1 016 000	EUR	984 603	948 355	0,02
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	2 685 000	EUR	2 648 448	2 634 119	0,07
Vodafone Group PLC 2.50% 19 - 24.05.39	1 100 000	EUR	963 296	959 717	0,02
Vodafone Group PLC 2.875% 17 - 20.11.37	1 100 000	EUR	1 003 550	1 014 959	0,03
Wellcome Trust Ltd. 1.125% 15 - 21.01.27	700 000	EUR	664 641	666 631	0,02
WPP Finance 2016 1.375% 18 - 20.03.25	770 000	EUR	752 389	748 563	0,02
Yorkshire Building Society 0.50% 21 - 01.07.28	778 000	EUR	685 275	680 929	0,02
Yorkshire Building Society 0.625% 20 - 21.09.25	1 000 000	EUR	949 253	949 350	0,02
			238 414 151	240 823 148	6,23
États-Unis					
3M Co. 1.50% 14 - 09.11.26	860 000	EUR	850 823	810 627	0,02
3M Co. 1.50% 16 - 02.06.31	850 000	EUR	742 668	724 183	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
3M Co. 1.75% 15 - 15.05.30	806 000	EUR	737 945	717 437	0,02
AbbVie Inc. 0.75% 19 - 18.11.27	1 198 000	EUR	1 097 776	1 105 275	0,03
AbbVie Inc. 1.25% 19 - 18.11.31	900 000	EUR	774 195	785 772	0,02
AbbVie Inc. 1.25% 19 - 18.11.31	200 000	EUR	161 778	174 616	0,00
AbbVie Inc. 2.125% 16 - 17.11.28	1 300 000	EUR	1 263 851	1 252 758	0,03
AbbVie Inc. 2.125% 20 - 01.06.29	643 000	EUR	599 025	614 290	0,02
AbbVie Inc. 2.625% 20 - 15.11.28	450 000	EUR	450 025	442 535	0,01
Air Products and Chemicals Inc. 0.50% 20 - 05.05.28	570 000	EUR	527 990	514 847	0,01
Air Products and Chemicals Inc. 0.80% 20 - 05.05.32	857 000	EUR	723 367	711 319	0,02
Air Products and Chemicals Inc. 1.00% 15 - 12.02.25	600 000	EUR	584 206	585 168	0,02
Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 23 - 03.03.35	980 000	EUR	974 101	1 033 939	0,03
Alcon Finance BV 2.375% 22 - 31.05.28	776 000	EUR	723 991	749 965	0,02
Altria Group Inc. 1.70% 19 - 15.06.25	1 338 000	EUR	1 299 939	1 300 429	0,03
Altria Group Inc. 2.20% 19 - 15.06.27	1 320 000	EUR	1 268 746	1 271 305	0,03
Altria Group Inc. 3.125% 19 - 15.06.31	1 857 000	EUR	1 729 773	1 686 175	0,04
American Honda Finance Corp. 0.30% 21 - 07.07.28	1 700 000	EUR	1 509 684	1 505 010	0,04
American Honda Finance Corp. 3.75% 23 - 25.10.27	1 380 000	EUR	1 374 262	1 415 618	0,04
American International Group Inc. 1.875% 17 - 21.06.27	1 259 000	EUR	1 199 413	1 205 115	0,03
American Tower Corp. 0.40% 21 - 15.02.27	790 000	EUR	718 760	719 935	0,02
American Tower Corp. 0.45% 21 - 15.01.27	1 165 000	EUR	1 064 278	1 065 486	0,03
American Tower Corp. 0.50% 20 - 15.01.28	1 287 000	EUR	1 152 763	1 147 772	0,03
American Tower Corp. 0.875% 21 - 21.05.29	1 310 000	EUR	1 131 141	1 141 966	0,03
American Tower Corp. 0.95% 21 - 05.10.30	770 000	EUR	641 637	645 791	0,02
American Tower Corp. 1.00% 20 - 15.01.32	871 000	EUR	716 391	712 583	0,02
American Tower Corp. 1.25% 21 - 21.05.33	695 000	EUR	559 343	559 510	0,01
American Tower Corp. 1.375% 17 - 04.04.25	600 000	EUR	583 453	582 414	0,02
American Tower Corp. 1.95% 18 - 22.05.26	718 000	EUR	694 165	692 511	0,02
American Tower Corp. 4.125% 23 - 16.05.27	820 000	EUR	817 102	837 876	0,02
American Tower Corp. 4.625% 23 - 16.05.31	800 000	EUR	796 321	842 824	0,02
Amgen Inc. 2.00% 16 - 25.02.26	1 100 000	EUR	1 077 385	1 074 282	0,03
Apple Inc. Zero Coupon 19 - 15.11.25	1 400 000	EUR	1 334 031	1 327 396	0,03
Apple Inc. 0.50% 19 - 15.11.31	1 400 000	EUR	1 226 265	1 192 758	0,03
Apple Inc. 0.875% 17 - 24.05.25	1 768 000	EUR	1 738 376	1 713 051	0,04
Apple Inc. 1.375% 17 - 24.05.29	1 988 000	EUR	1 906 172	1 867 845	0,05
Apple Inc. 1.625% 14 - 10.11.26	2 153 000	EUR	2 113 049	2 091 166	0,05
Apple Inc. 2.00% 15 - 17.09.27	1 664 000	EUR	1 649 385	1 628 124	0,04
Archer-Daniels-Midland Co. 1.00% 18 - 12.09.25	1 059 000	EUR	1 019 791	1 020 548	0,03
AT&T Inc. 0.25% 19 - 04.03.26	1 681 000	EUR	1 597 322	1 578 072	0,04
AT&T Inc. 0.80% 19 - 04.03.30	1 800 000	EUR	1 613 117	1 564 542	0,04
AT&T Inc. 1.60% 20 - 19.05.28	2 550 000	EUR	2 403 302	2 393 455	0,06
AT&T Inc. 1.80% 18 - 05.09.26	2 144 000	EUR	2 093 272	2 069 689	0,05
AT&T Inc. 1.80% 19 - 14.09.39	1 100 000	EUR	803 617	837 837	0,02
AT&T Inc. 2.05% 20 - 19.05.32	1 111 000	EUR	990 769	1 003 011	0,03
AT&T Inc. 2.35% 18 - 05.09.29	2 000 000	EUR	1 921 571	1 916 620	0,05
AT&T Inc. 2.45% 15 - 15.03.35	1 900 000	EUR	1 727 609	1 689 442	0,04
AT&T Inc. 2.60% 14 - 17.12.29	1 245 000	EUR	1 224 122	1 200 329	0,03
AT&T Inc. 2.60% 20 - 19.05.38	707 000	EUR	568 158	606 507	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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. 3.15% 17 - 04.09.36	2 617 000	EUR	2 573 299	2 437 343	0,06
AT&T Inc. 3.375% 14 - 15.03.34	700 000	EUR	663 122	685 188	0,02
AT&T Inc. 3.50% 13 - 17.12.25	1 600 000	EUR	1 608 789	1 603 632	0,04
AT&T Inc. 3.55% 12 - 17.12.32	2 100 000	EUR	2 110 771	2 106 069	0,05
AT&T Inc. 3.55% 23 - 18.11.25	1 230 000	EUR	1 224 759	1 236 716	0,03
AT&T Inc. 3.55% 23 - 18.11.25	100 000	EUR	99 156	100 546	0,00
AT&T Inc. 3.95% 23 - 30.04.31	1 450 000	EUR	1 437 768	1 504 215	0,04
AT&T Inc. 4.30% 23 - 18.11.34	1 960 000	EUR	1 984 365	2 070 995	0,05
Athene Global Funding 0.366% 21 - 10.09.26	1 210 000	EUR	1 115 902	1 107 658	0,03
Athene Global Funding 0.625% 21 - 12.01.28	500 000	EUR	440 208	444 905	0,01
Athene Global Funding 0.832% 22 - 08.01.27	729 000	EUR	654 393	673 377	0,02
Athene Global Funding 1.125% 20 - 02.09.25	700 000	EUR	668 229	667 723	0,02
Autoliv Inc. 4.25% 23 - 15.03.28	600 000	EUR	600 993	615 396	0,02
Avery Dennison Corp. 1.25% 17 - 03.03.25	670 000	EUR	654 945	650 081	0,02
Avery Dennison Corp. 1.25% 17 - 03.03.25	200 000	EUR	193 110	194 054	0,01
Bank of America Corp. FRN 19 - 08.08.29	1 532 000	EUR	1 349 783	1 344 851	0,03
Bank of America Corp. FRN 21 - 24.08.28	1 600 000	EUR	1 449 739	1 441 920	0,04
Bank of America Corp. FRN 20 - 26.10.31	2 400 000	EUR	2 000 001	1 965 696	0,05
Bank of America Corp. FRN 21 - 22.03.31	2 400 000	EUR	2 059 543	2 005 512	0,05
Bank of America Corp. FRN 19 - 09.05.26	2 000 000	EUR	1 921 334	1 922 120	0,05
Bank of America Corp. FRN 21 - 24.05.32	2 000 000	EUR	1 690 574	1 666 600	0,04
Bank of America Corp. 1.375% 15 - 26.03.25	1 000 000	EUR	979 030	975 080	0,03
Bank of America Corp. FRN 19 - 09.05.30	1 878 000	EUR	1 710 235	1 679 120	0,04
Bank of America Corp. FRN 18 - 25.04.28	1 765 000	EUR	1 687 724	1 668 013	0,04
Bank of America Corp. FRN 17 - 04.05.27	2 200 000	EUR	2 127 380	2 113 606	0,05
Bank of America Corp. FRN 22 - 27.10.26	2 700 000	EUR	2 606 886	2 621 403	0,07
Bank of America Corp. FRN 22 - 27.04.33	2 510 000	EUR	2 321 131	2 355 033	0,06
Bank of America Corp. FRN 20 - 31.03.29	2 081 000	EUR	2 094 690	2 095 026	0,05
Bank of America Corp. 4.134% 23 - 12.06.28	1 650 000	EUR	1 641 021	1 701 595	0,04
Baxter International Inc. 1.30% 17 - 30.05.25	1 173 000	EUR	1 147 730	1 133 470	0,03
Baxter International Inc. 1.30% 19 - 15.05.29	900 000	EUR	815 492	807 804	0,02
Becton Dickinson & Co. 0.034% 21 - 13.08.25	910 000	EUR	861 212	861 743	0,02
Becton Dickinson & Co. 1.90% 16 - 15.12.26	655 000	EUR	637 333	632 848	0,02
Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 22 - 18.03.30	779 000	EUR	705 314	706 444	0,02
Berkshire Hathaway Finance Corp. 2.00% 22 - 18.03.34	1 118 000	EUR	971 979	992 806	0,03
Berkshire Hathaway Inc. Zero Coupon 20 - 12.03.25	1 435 000	EUR	1 388 401	1 380 585	0,04
Berkshire Hathaway Inc. 0.50% 21 - 15.01.41	880 000	EUR	543 705	545 829	0,01
Berkshire Hathaway Inc. 1.125% 15 - 16.03.27	1 965 000	EUR	1 874 786	1 852 170	0,05
Berkshire Hathaway Inc. 1.625% 15 - 16.03.35	1 475 000	EUR	1 291 071	1 245 829	0,03
Berkshire Hathaway Inc. 2.15% 16 - 15.03.28	1 100 000	EUR	1 074 746	1 069 596	0,03
Berry Global Inc. 1.00% 20 - 15.01.25	900 000	EUR	878 392	872 379	0,02
Berry Global Inc. 1.50% 20 - 15.01.27	400 000	EUR	373 322	374 324	0,01
BlackRock Inc. 1.25% 15 - 06.05.25	1 023 000	EUR	997 182	997 865	0,03
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 1.00% 16 - 05.10.26	934 000	EUR	867 994	874 523	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.50% 19 - 10.04.29	1 100 000	EUR	1 006 673	995 511	0,03
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 2.00% 15 - 19.05.25	200 000	EUR	200 509	195 866	0,01
Blackstone Holdings Finance Co. LLC 3.50% 22 - 01.06.34	676 000	EUR	618 641	653 807	0,02
Blackstone Private Credit Fund 1.75% 21 - 30.11.26	800 000	EUR	709 597	714 760	0,02
BMW US Capital LLC 1.00% 15 - 20.04.27	800 000	EUR	753 811	754 664	0,02
Booking Holdings Inc. 0.10% 21 - 08.03.25	1 300 000	EUR	1 256 260	1 249 300	0,03
Booking Holdings Inc. 0.50% 21 - 08.03.28	1 100 000	EUR	993 807	997 370	0,03
Booking Holdings Inc. 1.80% 15 - 03.03.27	1 500 000	EUR	1 445 437	1 444 080	0,04
Booking Holdings Inc. 3.625% 23 - 12.11.28	620 000	EUR	620 438	637 038	0,02
Booking Holdings Inc. 4.00% 22 - 15.11.26	1 300 000	EUR	1 315 862	1 335 529	0,03
Booking Holdings Inc. 4.125% 23 - 12.05.33	1 840 000	EUR	1 841 371	1 963 519	0,05
Booking Holdings Inc. 4.25% 22 - 15.05.29	1 230 000	EUR	1 258 098	1 301 660	0,03
Booking Holdings Inc. 4.50% 22 - 15.11.31	1 470 000	EUR	1 520 867	1 600 139	0,04
Booking Holdings Inc. 4.75% 22 - 15.11.34	1 550 000	EUR	1 620 536	1 747 702	0,05
BorgWarner Inc. 1.00% 21 - 19.05.31	1 400 000	EUR	1 126 883	1 152 088	0,03
Boston Scientific Corp. 0.625% 19 - 01.12.27	1 400 000	EUR	1 275 636	1 279 348	0,03
Bristol-Myers Squibb Co. 1.00% 15 - 15.05.25	700 000	EUR	685 510	679 350	0,02
Bristol-Myers Squibb Co. 1.75% 15 - 15.05.35	800 000	EUR	678 137	706 944	0,02
Brown-Forman Corp. 1.20% 16 - 07.07.26	419 000	EUR	398 323	399 998	0,01
Capital One Financial Corp. 1.65% 19 - 12.06.29	600 000	EUR	493 989	528 132	0,01
Cargill Inc. 3.875% 23 - 24.04.30	600 000	EUR	600 487	622 572	0,02
Carrier Global Corp. 4.125% 23 - 29.05.28	1 110 000	EUR	1 116 420	1 143 877	0,03
Carrier Global Corp. 4.375% 23 - 29.05.25	950 000	EUR	950 666	958 237	0,02
Carrier Global Corp. 4.50% 23 - 29.11.32	1 360 000	EUR	1 385 752	1 455 064	0,04
Caterpillar Financial Services Corp. 3.742% 23 - 04.09.26	1 320 000	EUR	1 321 375	1 346 360	0,03
Celanese US Holdings LLC 0.625% 21 - 10.09.28	708 000	EUR	596 592	608 880	0,02
Celanese US Holdings LLC 1.25% 17 - 11.02.25	500 000	EUR	487 727	485 525	0,01
Celanese US Holdings LLC 2.125% 18 - 01.03.27	899 000	EUR	833 467	857 664	0,02
Celanese US Holdings LLC 4.777% 22 - 19.07.26	1 500 000	EUR	1 498 275	1 525 845	0,04
Celanese US Holdings LLC 5.337% 22 - 19.01.29	700 000	EUR	700 450	733 838	0,02
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.06.27	1 000 000	EUR	933 448	936 470	0,02
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.12.29	1 300 000	EUR	1 143 285	1 151 293	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 1.40% 19 - 15.06.31	750 000	EUR	652 141	660 540	0,02
Chubb INA Holdings Inc. 1.55% 18 - 15.03.28	1 240 000	EUR	1 185 077	1 170 076	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 2.50% 18 - 15.03.38	1 268 000	EUR	1 144 867	1 111 694	0,03
Citigroup Inc. FRN 19 - 08.10.27	2 222 000	EUR	2 081 299	2 053 350	0,05
Citigroup Inc. 1.25% 19 - 10.04.29	1 905 000	EUR	1 710 645	1 712 709	0,04
Citigroup Inc. FRN 20 - 06.07.26	2 897 000	EUR	2 808 262	2 789 492	0,07
Citigroup Inc. 1.50% 16 - 26.10.28	1 730 000	EUR	1 573 778	1 593 157	0,04
Citigroup Inc. FRN 18 - 24.07.26	2 725 000	EUR	2 657 558	2 631 042	0,07
Citigroup Inc. 1.625% 18 - 21.03.28	1 008 000	EUR	952 007	945 524	0,02
Citigroup Inc. 1.75% 15 - 28.01.25	1 626 000	EUR	1 606 340	1 590 813	0,04
Citigroup Inc. 2.125% 14 - 10.09.26	1 100 000	EUR	1 086 964	1 059 058	0,03
Citigroup Inc. FRN 22 - 22.09.28	1 500 000	EUR	1 487 156	1 521 945	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Citigroup Inc. FRN 22 - 22.09.33	1 600 000	EUR	1 553 680	1 650 512	0,04
Citigroup Inc. FRN 05 - 25.02.30	755 000	EUR	787 864	753 898	0,02
Coca-Cola Co. 0.125% 20 - 15.03.29	1 600 000	EUR	1 409 315	1 395 152	0,04
Coca-Cola Co. 0.125% 21 - 09.03.29	1 052 000	EUR	952 913	916 418	0,02
Coca-Cola Co. 0.375% 20 - 15.03.33	1 336 000	EUR	1 057 668	1 063 162	0,03
Coca-Cola Co. 0.40% 21 - 06.05.30	900 000	EUR	767 892	772 533	0,02
Coca-Cola Co. 0.40% 21 - 06.05.30	100 000	EUR	81 983	85 837	0,00
Coca-Cola Co. 0.50% 21 - 09.03.33	890 000	EUR	723 358	715 854	0,02
Coca-Cola Co. 0.75% 19 - 22.09.26	800 000	EUR	758 264	758 544	0,02
Coca-Cola Co. 0.80% 20 - 15.03.40	1 196 000	EUR	869 132	833 026	0,02
Coca-Cola Co. 0.95% 21 - 06.05.36	700 000	EUR	565 114	544 978	0,01
Coca-Cola Co. 1.00% 21 - 09.03.41	910 000	EUR	627 318	650 978	0,02
Coca-Cola Co. 1.10% 16 - 02.09.36	800 000	EUR	620 206	631 488	0,02
Coca-Cola Co. 1.125% 15 - 09.03.27	2 184 000	EUR	2 113 812	2 060 648	0,05
Coca-Cola Co. 1.25% 19 - 08.03.31	1 175 000	EUR	1 073 627	1 052 741	0,03
Coca-Cola Co. 1.625% 15 - 09.03.35	2 192 000	EUR	1 984 124	1 894 195	0,05
Coca-Cola Co. 1.875% 14 - 22.09.26	1 100 000	EUR	1 086 438	1 067 176	0,03
Colgate-Palmolive Co. 0.30% 21 - 10.11.29	1 026 000	EUR	878 784	896 950	0,02
Colgate-Palmolive Co. 0.50% 19 - 06.03.26	600 000	EUR	576 558	570 726	0,01
Colgate-Palmolive Co. 0.875% 19 - 12.11.39	810 000	EUR	560 272	579 612	0,01
Colgate-Palmolive Co. 1.375% 19 - 06.03.34	700 000	EUR	597 201	612 290	0,02
Comcast Corp. Zero Coupon 21 - 14.09.26	1 800 000	EUR	1 685 401	1 660 230	0,04
Comcast Corp. 0.25% 20 - 20.05.27	1 251 000	EUR	1 151 829	1 146 879	0,03
Comcast Corp. 0.25% 21 - 14.09.29	708 000	EUR	612 791	612 108	0,02
Comcast Corp. 0.75% 20 - 20.02.32	2 100 000	EUR	1 843 988	1 765 806	0,05
Comcast Corp. 1.25% 20 - 20.02.40	1 116 000	EUR	820 415	844 232	0,02
Computershare US Inc. 1.125% 21 - 07.10.31	700 000	EUR	555 528	543 445	0,01
Corning Inc. 3.875% 23 - 15.05.26	600 000	EUR	599 333	606 582	0,02
Corning Inc. 4.125% 23 - 15.05.31	800 000	EUR	789 651	837 064	0,02
Danaher Corp. 2.10% 20 - 30.09.26	1 038 000	EUR	1 022 518	1 014 853	0,03
Danaher Corp. 2.50% 20 - 30.03.30	1 025 000	EUR	995 253	994 476	0,03
Digital Euro Finco LLC 1.125% 19 - 09.04.28	605 000	EUR	541 349	547 525	0,01
Digital Euro Finco LLC 2.50% 19 - 16.01.26	1 582 000	EUR	1 542 048	1 540 298	0,04
Discovery Communications LLC 1.90% 15 - 19.03.27	906 000	EUR	848 179	862 186	0,02
Dover Corp. 0.75% 19 - 04.11.27	900 000	EUR	837 590	823 842	0,02
Dover Corp. 1.25% 16 - 09.11.26	828 000	EUR	801 714	788 761	0,02
Dover Corp. 1.25% 16 - 09.11.26	93 000	EUR	90 245	88 593	0,00
Dow Chemical Co. 0.50% 20 - 15.03.27	1 545 000	EUR	1 435 758	1 417 476	0,04
Dow Chemical Co. 1.125% 20 - 15.03.32	1 200 000	EUR	996 179	999 252	0,03
Dow Chemical Co. 1.875% 20 - 15.03.40	700 000	EUR	502 301	528 976	0,01
Duke Energy Corp. 3.10% 22 - 15.06.28	700 000	EUR	672 577	690 221	0,02
Duke Energy Corp. 3.85% 22 - 15.06.34	800 000	EUR	755 101	790 712	0,02
DXC Technology Co. 1.75% 18 - 15.01.26	850 000	EUR	808 597	820 556	0,02
Eastman Chemical Co. 1.875% 16 - 23.11.26	862 000	EUR	821 595	826 080	0,02
Ecolab Inc. 2.625% 15 - 08.07.25	1 030 000	EUR	1 025 855	1 018 310	0,03
Eli Lilly & Co. 0.50% 21 - 14.09.33	900 000	EUR	716 865	732 906	0,02
Eli Lilly & Co. 0.625% 19 - 01.11.31	877 000	EUR	778 649	751 729	0,02
Eli Lilly & Co. 1.125% 21 - 14.09.51	700 000	EUR	418 470	455 560	0,01

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Eli Lilly & Co. 1.375% 21 - 14.09.61	1 100 000	EUR	594 475	688 259	0,02
Eli Lilly & Co. 1.625% 15 - 02.06.26	909 000	EUR	897 404	883 184	0,02
Eli Lilly & Co. 1.70% 19 - 01.11.49	1 550 000	EUR	1 328 045	1 170 405	0,03
Eli Lilly & Co. 2.125% 15 - 03.06.30	1 266 000	EUR	1 264 115	1 227 754	0,03
Emerson Electric Co. 1.25% 19 - 15.10.25	900 000	EUR	881 411	870 426	0,02
Emerson Electric Co. 2.00% 19 - 15.10.29	700 000	EUR	673 237	665 371	0,02
Equinix Inc. 0.25% 21 - 15.03.27	895 000	EUR	810 270	814 942	0,02
Equinix Inc. 1.00% 21 - 15.03.33	900 000	EUR	710 015	727 731	0,02
Equitable Financial Life Global Funding 0.60% 21 - 16.06.28	800 000	EUR	697 238	711 360	0,02
Euronet Worldwide Inc. 1.375% 19 - 22.05.26	700 000	EUR	904 785	655 977	0,02
Exxon Mobil Corp. 0.524% 20 - 26.06.28	1 500 000	EUR	1 382 851	1 358 865	0,04
Exxon Mobil Corp. 0.835% 20 - 26.06.32	1 610 000	EUR	1 322 503	1 333 193	0,03
Exxon Mobil Corp. 1.408% 20 - 26.06.39	1 500 000	EUR	1 103 979	1 110 285	0,03
FedEx Corp. 0.45% 19 - 05.08.25	900 000	EUR	858 283	860 769	0,02
FedEx Corp. 0.45% 21 - 04.05.29	910 000	EUR	787 206	790 936	0,02
FedEx Corp. 0.95% 21 - 04.05.33	957 000	EUR	756 922	755 284	0,02
FedEx Corp. 1.30% 19 - 05.08.31	675 000	EUR	604 242	596 106	0,02
FedEx Corp. 1.625% 16 - 11.01.27	1 715 000	EUR	1 651 007	1 642 867	0,04
Fidelity National Information Services Inc. 0.625% 19 - 03.12.25	900 000	EUR	861 384	855 333	0,02
Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 19 - 03.12.28	1 113 000	EUR	986 680	1 004 282	0,03
Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 19 - 21.05.27	1 720 000	EUR	1 669 653	1 627 894	0,04
Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 19 - 21.05.30	1 362 000	EUR	1 249 089	1 263 228	0,03
Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 19 - 21.05.39	800 000	EUR	689 836	701 528	0,02
Fiserv Inc. 1.125% 19 - 01.07.27	800 000	EUR	746 356	750 256	0,02
Fiserv Inc. 1.625% 19 - 01.07.30	619 000	EUR	566 691	559 526	0,01
Fiserv Inc. 4.50% 23 - 24.05.31	1 270 000	EUR	1 274 992	1 347 635	0,03
Ford Motor Credit Co. LLC 2.386% 19 - 17.02.26	1 950 000	EUR	1 864 378	1 894 542	0,05
Ford Motor Credit Co. LLC 3.25% 20 - 15.09.25	1 700 000	EUR	1 661 936	1 678 818	0,04
Ford Motor Credit Co. LLC 4.867% 23 - 03.08.27	1 660 000	EUR	1 658 660	1 706 729	0,04
Ford Motor Credit Co. LLC 5.125% 23 - 20.02.29	1 010 000	EUR	1 018 562	1 057 450	0,03
Ford Motor Credit Co. LLC 6.125% 23 - 15.05.28	870 000	EUR	907 564	939 461	0,02
General Electric Co. 0.875% 17 - 17.05.25	400 000	EUR	382 755	386 336	0,01
General Electric Co. 0.875% 17 - 17.05.25	900 000	EUR	874 539	869 256	0,02
General Electric Co. 1.50% 17 - 17.05.29	1 300 000	EUR	1 247 963	1 203 462	0,03
General Electric Co. 1.875% 15 - 28.05.27	950 000	EUR	918 056	907 602	0,02
General Electric Co. 2.125% 17 - 17.05.37	800 000	EUR	701 153	699 880	0,02
General Electric Co. 4.125% 05 - 19.09.35	1 113 000	EUR	1 177 629	1 190 899	0,03
General Mills Inc. 0.125% 21 - 15.11.25	826 000	EUR	781 304	780 058	0,02
General Mills Inc. 0.45% 20 - 15.01.26	1 039 000	EUR	986 453	980 255	0,03
General Mills Inc. 1.50% 15 - 27.04.27	360 000	EUR	342 781	340 416	0,01
General Mills Inc. 3.907% 23 - 13.04.29	1 220 000	EUR	1 222 481	1 258 747	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Motors Financial Co. Inc. 0.60% 21 - 20.05.27	1 089 000	EUR	998 344	995 194	0,03
General Motors Financial Co. Inc. 0.65% 21 - 07.09.28	800 000	EUR	681 078	703 712	0,02
General Motors Financial Co. Inc. 0.85% 20 - 26.02.26	868 000	EUR	830 812	823 897	0,02
General Motors Financial Co. Inc. 1.00% 22 - 24.02.25	812 000	EUR	788 562	787 583	0,02
General Motors Financial Co. Inc. 1.694% 18 - 26.03.25	900 000	EUR	884 051	877 329	0,02
General Motors Financial Co. Inc. 4.30% 23 - 15.02.29	1 056 000	EUR	1 034 554	1 087 944	0,03
General Motors Financial Co. Inc. 4.50% 23 - 22.11.27	1 000 000	EUR	997 706	1 036 310	0,03
Global Payments Inc. 4.875% 23 - 17.03.31	1 200 000	EUR	1 192 447	1 259 076	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 0.25% 21 - 26.01.28	2 600 000	EUR	2 343 724	2 302 430	0,06
Goldman Sachs Group Inc. 0.75% 21 - 23.03.32	1 771 000	EUR	1 387 649	1 415 064	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 20 - 21.01.30	1 660 000	EUR	1 396 536	1 428 397	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 20 - 21.01.30	540 000	EUR	508 949	464 659	0,01
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 21 - 09.05.29	1 553 000	EUR	1 380 936	1 350 194	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 21 - 18.03.33	1 700 000	EUR	1 370 815	1 350 378	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 1.25% 16 - 01.05.25	1 835 000	EUR	1 790 299	1 777 528	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 1.25% 22 - 07.02.29	2 000 000	EUR	1 792 021	1 789 540	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 1.625% 16 - 27.07.26	3 117 000	EUR	3 025 721	2 996 216	0,08
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 22.03.28	1 072 000	EUR	1 020 443	1 023 052	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 01.11.28	2 100 000	EUR	1 995 464	1 985 340	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 2.875% 14 - 03.06.26	994 000	EUR	991 797	986 684	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 3.00% 16 - 12.02.31	1 638 000	EUR	1 584 507	1 611 759	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 3.375% 20 - 27.03.25	3 066 000	EUR	3 082 758	3 059 745	0,08
Goldman Sachs Group Inc. 4.00% 22 - 21.09.29	1 350 000	EUR	1 326 445	1 393 065	0,04
Harley-Davidson Financial Services Inc. 5.125% 23 - 05.04.26	1 200 000	EUR	1 211 064	1 237 956	0,03
Honeywell International Inc. 0.75% 20 - 10.03.32	893 000	EUR	735 045	738 502	0,02
Honeywell International Inc. 2.25% 16 - 22.02.28	1 185 000	EUR	1 149 748	1 155 967	0,03
Honeywell International Inc. 3.50% 23 - 17.05.27	880 000	EUR	877 561	893 790	0,02
Honeywell International Inc. 3.75% 23 - 17.05.32	600 000	EUR	592 457	621 600	0,02
Honeywell International Inc. 4.125% 22 - 02.11.34	1 500 000	EUR	1 509 331	1 591 590	0,04
IHG Finance LLC 4.375% 23 - 28.11.29	1 090 000	EUR	1 107 844	1 129 938	0,03
Illinois Tool Works Inc. 0.625% 19 - 05.12.27	783 000	EUR	727 581	720 344	0,02
Illinois Tool Works Inc. 1.00% 19 - 05.06.31	890 000	EUR	768 596	783 271	0,02
Illinois Tool Works Inc. 2.125% 15 - 22.05.30	575 000	EUR	556 089	550 936	0,01
Illinois Tool Works Inc. 3.00% 14 - 19.05.34	806 000	EUR	803 166	800 382	0,02
International Business Machines Corp. 0.30% 20 - 11.02.28	1 963 000	EUR	1 814 117	1 768 388	0,05
International Business Machines Corp. 0.65% 20 - 11.02.32	2 400 000	EUR	2 048 490	1 984 296	0,05
International Business Machines Corp. 0.875% 19 - 31.01.25	1 020 000	EUR	1 006 616	990 532	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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. 0.875% 19 - 31.01.25	200 000	EUR	195 502	194 222	0,01
International Business Machines Corp. 0.875% 22 - 09.02.30	1 421 000	EUR	1 262 270	1 257 045	0,03
International Business Machines Corp. 0.95% 17 - 23.05.25	1 606 000	EUR	1 568 431	1 552 825	0,04
International Business Machines Corp. 1.20% 20 - 11.02.40	1 192 000	EUR	947 440	865 809	0,02
International Business Machines Corp. 1.25% 19 - 29.01.27	1 466 000	EUR	1 414 517	1 392 773	0,04
International Business Machines Corp. 1.25% 22 - 09.02.34	1 521 000	EUR	1 304 271	1 272 195	0,03
International Business Machines Corp. 1.50% 17 - 23.05.29	1 781 000	EUR	1 658 996	1 658 218	0,04
International Business Machines Corp. 1.75% 16 - 07.03.28	653 000	EUR	609 929	625 966	0,02
International Business Machines Corp. 1.75% 19 - 31.01.31	2 002 000	EUR	1 874 649	1 836 815	0,05
International Business Machines Corp. 2.875% 13 - 07.11.25	1 481 000	EUR	1 486 537	1 472 010	0,04
International Business Machines Corp. 3.375% 23 - 06.02.27	1 500 000	EUR	1 489 976	1 518 030	0,04
International Business Machines Corp. 3.625% 23 - 06.02.31	1 700 000	EUR	1 694 631	1 753 040	0,05
International Business Machines Corp. 3.75% 23 - 06.02.35	1 500 000	EUR	1 479 528	1 565 040	0,04
International Business Machines Corp. 4.00% 23 - 06.02.43	1 500 000	EUR	1 450 489	1 559 670	0,04
International Flavors & Fragrances Inc. 1.80% 18 - 25.09.26	1 125 000	EUR	1 088 691	1 068 649	0,03
International Flavors & Fragrances Inc. 1.80% 18 - 25.09.26	100 000	EUR	93 809	94 991	0,00
Johnson & Johnson 1.15% 16 - 20.11.28	1 000 000	EUR	942 558	941 010	0,02
Johnson & Johnson 1.65% 16 - 20.05.35	2 300 000	EUR	2 081 264	2 064 227	0,05
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 24.02.28	2 000 000	EUR	1 844 663	1 822 080	0,05
JPMorgan Chase & Co. FRN 21 - 17.02.33	2 208 000	EUR	1 762 732	1 775 497	0,05
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 25.07.31	2 348 000	EUR	2 035 760	2 003 454	0,05
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 04.11.32	2 567 000	EUR	2 211 816	2 148 194	0,06
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 11.03.27	3 218 000	EUR	3 078 027	3 057 164	0,08
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 15 - 27.01.25	2 300 000	EUR	2 268 917	2 243 489	0,06
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 16 - 29.10.26	2 290 000	EUR	2 209 437	2 194 118	0,06
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 18.05.28	3 329 000	EUR	3 235 112	3 144 607	0,08
JPMorgan Chase & Co. FRN 18 - 12.06.29	1 700 000	EUR	1 584 050	1 589 959	0,04
JPMorgan Chase & Co. FRN 22 - 23.03.30	3 700 000	EUR	3 442 037	3 446 402	0,09
JPMorgan Chase & Co. 2.875% 13 - 24.05.28	1 630 000	EUR	1 603 929	1 605 175	0,04
JPMorgan Chase & Co. 3.00% 14 - 19.02.26	1 500 000	EUR	1 502 912	1 489 635	0,04
JPMorgan Chase & Co. FRN 23 - 13.11.31	2 800 000	EUR	2 880 077	2 951 480	0,08
Kellanova 0.50% 21 - 20.05.29	403 000	EUR	339 864	349 067	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Kellanova 1.25% 15 - 10.03.25	1 000 000	EUR	980 964	974 740	0,03
Kinder Morgan Inc. 2.25% 15 - 16.03.27	611 000	EUR	576 413	587 568	0,02
KKR Group Finance Co. V LLC 1.625% 19 - 22.05.29	829 000	EUR	724 007	746 846	0,02
Kraft Heinz Foods Co. 2.25% 16 - 25.05.28	1 800 000	EUR	1 718 561	1 739 790	0,04
Liberty Mutual Group Inc. 2.75% 16 - 04.05.26	1 250 000	EUR	1 226 432	1 229 812	0,03
Liberty Mutual Group Inc. 4.625% 22 - 02.12.30	700 000	EUR	692 667	733 425	0,02
Linde Inc. 1.625% 14 - 01.12.25	856 000	EUR	830 684	832 023	0,02
ManpowerGroup Inc. 1.75% 18 - 22.06.26	707 000	EUR	683 158	683 902	0,02
ManpowerGroup Inc. 3.50% 22 - 30.06.27	700 000	EUR	687 975	700 861	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.979% 19 - 21.03.30	700 000	EUR	650 055	659 589	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.349% 19 - 21.09.26	957 000	EUR	906 450	916 347	0,02
MassMutual Global Funding II 3.75% 23 - 19.01.30	702 000	EUR	692 376	717 690	0,02
Mastercard Inc. 1.00% 22 - 22.02.29	1 066 000	EUR	971 557	979 185	0,03
Mastercard Inc. 2.10% 15 - 01.12.27	1 472 000	EUR	1 446 892	1 432 653	0,04
McDonald's Corp. 0.25% 21 - 04.10.28	708 000	EUR	619 745	624 258	0,02
McDonald's Corp. 0.875% 21 - 04.10.33	808 000	EUR	651 678	651 224	0,02
McDonald's Corp. 0.90% 19 - 15.06.26	1 100 000	EUR	1 047 774	1 046 408	0,03
McDonald's Corp. 1.50% 17 - 28.11.29	1 000 000	EUR	932 025	914 500	0,02
McDonald's Corp. 1.60% 19 - 15.03.31	800 000	EUR	737 336	719 288	0,02
McDonald's Corp. 1.75% 16 - 03.05.28	1 000 000	EUR	967 120	949 340	0,02
McDonald's Corp. 1.875% 15 - 26.05.27	1 000 000	EUR	965 747	961 200	0,02
McDonald's Corp. 2.375% 22 - 31.05.29	1 010 000	EUR	970 590	979 225	0,03
McDonald's Corp. 2.625% 14 - 11.06.29	300 000	EUR	284 300	294 306	0,01
McDonald's Corp. 2.875% 13 - 17.12.25	300 000	EUR	296 527	299 721	0,01
McDonald's Corp. 3.00% 22 - 31.05.34	972 000	EUR	903 796	942 947	0,02
McDonald's Corp. 3.625% 23 - 28.11.27	720 000	EUR	724 307	735 343	0,02
McDonald's Corp. 3.875% 23 - 20.02.31	1 040 000	EUR	1 047 614	1 080 331	0,03
McDonald's Corp. 4.00% 23 - 07.03.30	500 000	EUR	508 460	523 580	0,01
McDonald's Corp. 4.125% 23 - 28.11.35	1 210 000	EUR	1 211 049	1 275 243	0,03
McDonald's Corp. 4.25% 23 - 07.03.35	800 000	EUR	812 430	859 408	0,02
McKesson Corp. 1.50% 17 - 17.11.25	1 186 000	EUR	1 162 788	1 148 902	0,03
McKesson Corp. 1.625% 18 - 30.10.26	662 000	EUR	631 239	637 446	0,02
Merck & Co. Inc. 1.375% 16 - 02.11.36	200 000	EUR	149 102	165 766	0,00
Merck & Co. Inc. 1.375% 16 - 02.11.36	613 000	EUR	498 378	508 073	0,01
Merck & Co. Inc. 1.875% 14 - 15.10.26	1 366 000	EUR	1 344 288	1 329 104	0,03
Merck & Co. Inc. 2.50% 14 - 15.10.34	700 000	EUR	667 079	677 782	0,02
Metropolitan Life Global Funding I 0.50% 21 - 25.05.29	604 000	EUR	549 823	525 504	0,01
Metropolitan Life Global Funding I 0.55% 20 - 16.06.27	890 000	EUR	815 399	817 109	0,02
Metropolitan Life Global Funding I 1.75% 22 - 25.05.25	776 000	EUR	759 554	757 562	0,02
Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 22 - 05.12.30	1 100 000	EUR	1 097 195	1 129 073	0,03
Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 23 - 07.12.31	750 000	EUR	777 158	772 088	0,02
Metropolitan Life Global Funding I 4.00% 23 - 05.04.28	1 010 000	EUR	1 009 191	1 042 482	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Microsoft Corp. 2.625% 13 - 02.05.33	700 000	EUR	672 407	706 517	0,02
Microsoft Corp. 3.125% 13 - 06.12.28	2 576 000	EUR	2 707 432	2 653 383	0,07
MMS USA Holdings Inc. 0.625% 19 - 13.06.25	1 300 000	EUR	1 263 327	1 245 634	0,03
MMS USA Holdings Inc. 1.25% 19 - 13.06.28	900 000	EUR	851 576	831 321	0,02
MMS USA Holdings Inc. 1.75% 19 - 13.06.31	1 300 000	EUR	1 146 328	1 176 448	0,03
Mondelez International Inc. 0.25% 21 - 17.03.28	1 318 000	EUR	1 175 924	1 178 516	0,03
Mondelez International Inc. 0.75% 21 - 17.03.33	900 000	EUR	723 857	727 056	0,02
Mondelez International Inc. 1.375% 21 - 17.03.41	950 000	EUR	704 554	696 113	0,02
Mondelez International Inc. 1.625% 15 - 08.03.27	1 073 000	EUR	1 054 034	1 025 037	0,03
Mondelez International Inc. 2.375% 15 - 06.03.35	650 000	EUR	626 339	587 425	0,02
Moody's Corp. 0.95% 19 - 25.02.30	1 228 000	EUR	1 103 771	1 090 145	0,03
Moody's Corp. 1.75% 15 - 09.03.27	720 000	EUR	689 140	693 691	0,02
Morgan Stanley FRN 21 - 29.10.27	2 700 000	EUR	2 499 045	2 479 302	0,06
Morgan Stanley FRN 20 - 26.10.29	2 446 000	EUR	2 115 815	2 111 681	0,05
Morgan Stanley FRN 21 - 07.02.31	2 600 000	EUR	2 204 962	2 153 268	0,06
Morgan Stanley FRN 21 - 29.04.33	2 500 000	EUR	2 026 398	2 029 425	0,05
Morgan Stanley FRN 17 - 23.10.26	1 614 000	EUR	1 553 024	1 549 004	0,04
Morgan Stanley 1.375% 16 - 27.10.26	2 125 000	EUR	2 043 661	2 018 474	0,05
Morgan Stanley 1.75% 15 - 30.01.25	2 036 000	EUR	2 019 367	1 994 425	0,05
Morgan Stanley 1.875% 17 - 27.04.27	2 910 000	EUR	2 800 456	2 776 635	0,07
Morgan Stanley FRN 22 - 08.05.26	2 300 000	EUR	2 249 635	2 247 744	0,06
Morgan Stanley FRN 22 - 07.05.32	2 329 000	EUR	2 180 580	2 204 212	0,06
Morgan Stanley FRN 23 - 02.03.29	3 000 000	EUR	3 034 008	3 114 780	0,08
Morgan Stanley FRN 22 - 25.10.28	1 500 000	EUR	1 525 132	1 569 810	0,04
Morgan Stanley FRN 22 - 25.01.34	2 700 000	EUR	2 809 335	2 965 464	0,08
Mylan Inc. 2.125% 18 - 23.05.25	800 000	EUR	781 353	780 752	0,02
Nasdaq Inc. 0.875% 20 - 13.02.30	996 000	EUR	858 542	864 598	0,02
Nasdaq Inc. 0.90% 21 - 30.07.33	821 000	EUR	644 641	650 733	0,02
Nasdaq Inc. 1.75% 19 - 28.03.29	920 000	EUR	856 977	853 732	0,02
Nasdaq Inc. 4.50% 23 - 15.02.32	1 120 000	EUR	1 128 114	1 198 938	0,03
National Grid North America Inc. 0.41% 22 - 20.01.26	820 000	EUR	769 422	773 432	0,02
National Grid North America Inc. 1.054% 22 - 20.01.31	610 000	EUR	514 982	515 401	0,01
National Grid North America Inc. 4.151% 23 - 12.09.27	800 000	EUR	797 910	821 656	0,02
National Grid North America Inc. 4.668% 23 - 12.09.33	700 000	EUR	690 293	747 460	0,02
Nestle Holdings Inc. 0.875% 17 - 18.07.25	1 600 000	EUR	1 565 353	1 543 264	0,04
Netflix Inc. 3.00% 20 - 15.06.25	700 000	EUR	690 768	696 241	0,02
Netflix Inc. 3.625% 17 - 15.05.27	1 800 000	EUR	1 785 787	1 821 294	0,05
Netflix Inc. 3.625% 19 - 15.06.30	1 600 000	EUR	1 544 005	1 630 544	0,04
Netflix Inc. 3.875% 19 - 15.11.29	2 000 000	EUR	1 969 768	2 066 140	0,05
Netflix Inc. 4.625% 18 - 15.05.29	1 700 000	EUR	1 734 424	1 816 569	0,05
New York Life Global Funding 0.25% 20 - 23.01.27	944 000	EUR	878 433	873 596	0,02
New York Life Global Funding 0.25% 21 - 04.10.28	1 210 000	EUR	1 083 131	1 071 455	0,03
New York Life Global Funding 3.625% 23 - 09.01.30	952 000	EUR	955 354	979 779	0,03
Northwestern Mutual Global Funding 4.109% 23 - 15.03.30	700 000	EUR	700 576	737 625	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Oracle Corp. 3.125% 13 - 10.07.25	1 001 000	EUR	1 000 101	998 958	0,03
Parker-Hannifin Corp. 1.125% 17 - 01.03.25	748 000	EUR	730 342	725 358	0,02
PepsiCo Inc. 0.40% 20 - 09.10.32	1 200 000	EUR	988 320	969 684	0,03
PepsiCo Inc. 0.50% 20 - 06.05.28	1 506 000	EUR	1 394 786	1 370 445	0,04
PepsiCo Inc. 0.75% 19 - 18.03.27	830 000	EUR	774 344	779 337	0,02
PepsiCo Inc. 0.75% 21 - 14.10.33	1 511 000	EUR	1 240 130	1 235 333	0,03
PepsiCo Inc. 0.875% 16 - 18.07.28	1 200 000	EUR	1 129 201	1 103 904	0,03
PepsiCo Inc. 0.875% 19 - 16.10.39	660 000	EUR	441 021	478 394	0,01
PepsiCo Inc. 1.05% 20 - 09.10.50	1 226 000	EUR	756 798	797 856	0,02
PepsiCo Inc. 1.125% 19 - 18.03.31	690 000	EUR	614 666	614 887	0,02
PepsiCo Inc. 2.625% 14 - 28.04.26	800 000	EUR	796 491	792 912	0,02
Pfizer Inc. 1.00% 17 - 06.03.27	1 183 000	EUR	1 120 883	1 120 443	0,03
Philip Morris International Inc. 0.125% 19 - 03.08.26	850 000	EUR	783 657	785 358	0,02
Philip Morris International Inc. 0.80% 19 - 01.08.31	1 060 000	EUR	887 107	864 409	0,02
Philip Morris International Inc. 1.45% 19 - 01.08.39	1 140 000	EUR	758 762	747 327	0,02
Philip Morris International Inc. 1.875% 17 - 06.11.37	700 000	EUR	504 927	524 475	0,01
Philip Morris International Inc. 1.875% 17 - 06.11.37	100 000	EUR	67 564	74 925	0,00
Philip Morris International Inc. 2.00% 16 - 09.05.36	683 000	EUR	550 331	535 383	0,01
Philip Morris International Inc. 2.75% 13 - 19.03.25	900 000	EUR	903 358	891 450	0,02
Philip Morris International Inc. 2.875% 14 - 03.03.26	1 479 000	EUR	1 479 674	1 465 837	0,04
Philip Morris International Inc. 2.875% 14 - 14.05.29	890 000	EUR	862 410	867 002	0,02
Philip Morris International Inc. 3.125% 13 - 03.06.33	583 000	EUR	552 150	564 589	0,01
PPG Industries Inc. 0.875% 16 - 03.11.25	1 064 000	EUR	1 016 918	1 016 705	0,03
PPG Industries Inc. 1.40% 15 - 13.03.27	722 000	EUR	691 074	680 918	0,02
PPG Industries Inc. 1.875% 22 - 01.06.25	586 000	EUR	570 690	572 481	0,01
PPG Industries Inc. 2.75% 22 - 01.06.29	1 067 000	EUR	1 012 290	1 042 395	0,03
Procter & Gamble Co. 0.35% 21 - 05.05.30	820 000	EUR	713 751	706 291	0,02
Procter & Gamble Co. 0.90% 21 - 04.11.41	1 006 000	EUR	708 694	709 351	0,02
Procter & Gamble Co. 1.20% 18 - 30.10.28	1 200 000	EUR	1 136 546	1 120 452	0,03
Procter & Gamble Co. 1.25% 17 - 25.10.29	500 000	EUR	466 230	461 440	0,01
Procter & Gamble Co. 1.875% 18 - 30.10.38	800 000	EUR	657 336	702 280	0,02
Procter & Gamble Co. 3.25% 23 - 02.08.26	1 180 000	EUR	1 175 528	1 191 953	0,03
Procter & Gamble Co. 3.25% 23 - 02.08.31	800 000	EUR	797 283	825 232	0,02
Procter & Gamble Co. 4.875% 07 - 11.05.27	1 680 000	EUR	1 821 884	1 789 250	0,05
Prologis Euro Finance LLC 0.25% 19 - 10.09.27	944 000	EUR	830 920	849 496	0,02
Prologis Euro Finance LLC 0.375% 20 - 06.02.28	745 000	EUR	674 409	664 175	0,02
Prologis Euro Finance LLC 0.50% 21 - 16.02.32	1 267 000	EUR	1 063 428	991 643	0,03
Prologis Euro Finance LLC 0.625% 19 - 10.09.31	1 079 000	EUR	876 897	881 306	0,02
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 20 - 06.02.35	881 000	EUR	689 161	656 741	0,02
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 21 - 16.02.41	793 000	EUR	465 802	499 328	0,01
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 22 - 08.02.29	650 000	EUR	579 377	577 298	0,01
Prologis Euro Finance LLC 1.50% 19 - 10.09.49	490 000	EUR	366 884	298 993	0,01
Prologis Euro Finance LLC 1.50% 19 - 10.09.49	300 000	EUR	160 094	183 057	0,00
Prologis Euro Finance LLC 1.50% 22 - 08.02.34	1 200 000	EUR	980 809	978 924	0,03
Prologis Euro Finance LLC 1.875% 18 - 05.01.29	1 110 000	EUR	1 043 632	1 032 533	0,03
Prologis Euro Finance LLC 3.875% 23 - 31.01.30	902 000	EUR	885 854	917 749	0,02
Prologis Euro Finance LLC 4.25% 23 - 31.01.43	952 000	EUR	911 420	959 702	0,02
Prologis Euro Finance LLC 4.625% 23 - 23.05.33	1 100 000	EUR	1 104 504	1 173 788	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 LP 3.00% 14 - 02.06.26	700 000	EUR	685 061	691 600	0,02
Public Storage 0.50% 21 - 09.09.30	1 111 000	EUR	956 159	918 142	0,02
Public Storage 0.875% 20 - 24.01.32	824 000	EUR	650 760	681 275	0,02
PVH Corp. 3.125% 17 - 15.12.27	950 000	EUR	911 190	930 307	0,02
Realty Income Corp. 4.875% 23 - 06.07.30	780 000	EUR	774 476	826 114	0,02
Realty Income Corp. 5.125% 23 - 06.07.34	860 000	EUR	858 873	949 380	0,02
RELX Capital Inc. 1.30% 15 - 12.05.25	900 000	EUR	879 255	874 476	0,02
Revvity Inc. 1.875% 16 - 19.07.26	602 000	EUR	572 496	579 937	0,01
RTX Corp. 2.15% 18 - 18.05.30	805 000	EUR	734 160	737 952	0,02
Southern Co. FRN 21 - 15.09.81	1 862 000	EUR	1 574 547	1 596 516	0,04
Southern Power Co. 1.85% 16 - 20.06.26	500 000	EUR	489 892	483 465	0,01
Southern Power Co. 1.85% 16 - 20.06.26	300 000	EUR	286 523	290 079	0,01
Stryker Corp. 0.75% 19 - 01.03.29	1 194 000	EUR	1 069 900	1 061 729	0,03
Stryker Corp. 1.00% 19 - 03.12.31	1 171 000	EUR	974 788	990 256	0,03
Stryker Corp. 2.125% 18 - 30.11.27	1 080 000	EUR	1 046 394	1 045 213	0,03
Stryker Corp. 2.625% 18 - 30.11.30	1 057 000	EUR	1 008 581	1 023 091	0,03
Stryker Corp. 3.375% 23 - 11.12.28	900 000	EUR	909 763	913 752	0,02
Tapestry Inc. 5.35% 23 - 27.11.25	600 000	EUR	607 452	612 228	0,02
Tapestry Inc. 5.375% 23 - 27.11.27	840 000	EUR	851 416	870 131	0,02
Tapestry Inc. 5.875% 23 - 27.11.31	840 000	EUR	852 472	882 798	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.125% 19 - 01.03.25	1 000 000	EUR	967 134	961 630	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.50% 19 - 01.03.28	1 250 000	EUR	1 139 306	1 136 337	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.875% 19 - 01.10.31	1 298 000	EUR	1 104 390	1 107 090	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.375% 16 - 12.09.28	900 000	EUR	841 649	840 861	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.40% 17 - 23.01.26	1 000 000	EUR	981 677	964 920	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.45% 17 - 16.03.27	700 000	EUR	671 068	668 843	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.50% 19 - 01.10.39	1 320 000	EUR	1 057 480	1 006 711	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.75% 20 - 15.04.27	1 014 000	EUR	985 177	977 983	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.875% 19 - 01.10.49	1 466 000	EUR	1 075 197	1 048 058	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.95% 17 - 24.07.29	1 200 000	EUR	1 147 686	1 138 800	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.00% 14 - 15.04.25	900 000	EUR	894 553	881 604	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.375% 20 - 15.04.32	900 000	EUR	868 797	853 290	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.875% 17 - 24.07.37	1 061 000	EUR	1 000 848	1 004 385	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 3.20% 22 - 21.01.26	804 000	EUR	798 085	805 745	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 3.65% 22 - 21.11.34	1 100 000	EUR	1 086 665	1 144 968	0,03
Toyota Motor Credit Corp. 0.125% 21 - 05.11.27	1 580 000	EUR	1 443 263	1 417 781	0,04
Toyota Motor Credit Corp. 0.25% 20 - 16.07.26	1 466 000	EUR	1 406 385	1 367 925	0,04
Toyota Motor Credit Corp. 3.85% 23 - 24.07.30	1 300 000	EUR	1 300 916	1 350 778	0,03
Toyota Motor Credit Corp. 4.05% 23 - 13.09.29	1 500 000	EUR	1 516 428	1 573 725	0,04
Unilever Capital Corp. 3.30% 23 - 06.06.29	800 000	EUR	791 064	818 168	0,02
Unilever Capital Corp. 3.40% 23 - 06.06.33	1 000 000	EUR	980 322	1 030 550	0,03
United Parcel Service Inc. 1.00% 16 - 15.11.28	500 000	EUR	457 468	460 465	0,01
United Parcel Service Inc. 1.50% 17 - 15.11.32	750 000	EUR	661 060	658 530	0,02
United Parcel Service Inc. 1.625% 15 - 15.11.25	1 187 000	EUR	1 169 745	1 155 461	0,03
Utah Acquisition Sub Inc. 3.125% 16 - 22.11.28	992 000	EUR	963 539	966 218	0,02
Veralto Corp. 4.15% 23 - 19.09.31	800 000	EUR	797 277	831 760	0,02
Verizon Communications Inc. 0.375% 21 - 22.03.29	1 400 000	EUR	1 217 615	1 217 020	0,03
Verizon Communications Inc. 0.75% 21 - 22.03.32	1 590 000	EUR	1 262 147	1 303 911	0,03

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Verizon Communications Inc. 0.875% 16 - 02.04.25	1 298 000	EUR	1 268 607	1 257 308	0,03
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 08.04.27	1 833 000	EUR	1 723 491	1 713 268	0,04
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 19.03.32	1 144 000	EUR	987 230	946 305	0,02
Verizon Communications Inc. 1.125% 21 - 19.09.35	836 000	EUR	649 262	646 011	0,02
Verizon Communications Inc. 1.125% 21 - 19.09.35	200 000	EUR	138 028	154 548	0,00
Verizon Communications Inc. 1.125% 21 - 19.09.35	200 000	EUR	137 931	154 548	0,00
Verizon Communications Inc. 1.25% 19 - 08.04.30	1 962 000	EUR	1 797 897	1 747 651	0,05
Verizon Communications Inc. 1.30% 20 - 18.05.33	1 977 000	EUR	1 703 123	1 650 261	0,04
Verizon Communications Inc. 1.375% 16 - 02.11.28	1 792 000	EUR	1 721 727	1 660 413	0,04
Verizon Communications Inc. 1.375% 17 - 27.10.26	1 940 000	EUR	1 874 614	1 856 076	0,05
Verizon Communications Inc. 1.50% 19 - 19.09.39	748 000	EUR	535 465	560 125	0,01
Verizon Communications Inc. 1.85% 20 - 18.05.40	1 151 000	EUR	913 262	902 280	0,02
Verizon Communications Inc. 1.875% 17 - 26.10.29	1 150 000	EUR	1 087 937	1 072 916	0,03
Verizon Communications Inc. 2.625% 14 - 01.12.31	1 563 000	EUR	1 549 109	1 493 087	0,04
Verizon Communications Inc. 2.875% 17 - 15.01.38	2 150 000	EUR	2 064 157	1 985 353	0,05
Verizon Communications Inc. 3.25% 14 - 17.02.26	1 900 000	EUR	1 923 347	1 906 384	0,05
Verizon Communications Inc. 4.25% 22 - 31.10.30	1 800 000	EUR	1 831 146	1 908 108	0,05
Verizon Communications Inc. 4.75% 22 - 31.10.34	2 000 000	EUR	2 083 647	2 215 440	0,06
VF Corp. 0.25% 20 - 25.02.28	600 000	EUR	515 450	504 276	0,01
VF Corp. 0.625% 20 - 25.02.32	875 000	EUR	669 060	613 270	0,02
VF Corp. 4.125% 23 - 07.03.26	800 000	EUR	796 520	791 408	0,02
VF Corp. 4.25% 23 - 07.03.29	500 000	EUR	494 853	480 065	0,01
Visa Inc. 1.50% 22 - 15.06.26	2 286 000	EUR	2 211 092	2 208 916	0,06
Visa Inc. 2.00% 22 - 15.06.29	1 353 000	EUR	1 279 851	1 300 977	0,03
Visa Inc. 2.375% 22 - 15.06.34	919 000	EUR	844 382	877 948	0,02
Walmart Inc. 2.55% 14 - 08.04.26	749 000	EUR	751 760	742 956	0,02
Walmart Inc. 4.875% 09 - 21.09.29	1 626 000	EUR	1 811 799	1 809 348	0,05
Wells Fargo & Co. 0.625% 19 - 25.03.30	1 476 000	EUR	1 281 532	1 234 438	0,03
Wells Fargo & Co. 0.625% 20 - 14.08.30	1 464 000	EUR	1 236 996	1 211 094	0,03
Wells Fargo & Co. 1.00% 16 - 02.02.27	2 920 000	EUR	2 729 964	2 712 388	0,07
Wells Fargo & Co. 1.375% 16 - 26.10.26	3 000 000	EUR	2 876 426	2 832 510	0,07
Wells Fargo & Co. 1.50% 17 - 24.05.27	2 221 000	EUR	2 141 196	2 084 786	0,05
Wells Fargo & Co. 1.625% 15 - 02.06.25	1 850 000	EUR	1 812 120	1 797 312	0,05
Wells Fargo & Co. FRN 20 - 04.05.30	2 406 000	EUR	2 229 901	2 187 439	0,06
Wells Fargo & Co. 2.00% 15 - 27.04.26	2 456 000	EUR	2 730 651	2 373 454	0,06
Westlake Corp. 1.625% 19 - 17.07.29	1 000 000	EUR	876 480	897 590	0,02
Worley US Finance Sub Ltd. 0.875% 21 - 09.06.26	700 000	EUR	651 358	653 779	0,02
Zimmer Biomet Holdings Inc. 1.164% 19 - 15.11.27	814 000	EUR	751 049	754 375	0,02
Zimmer Biomet Holdings Inc. 2.425% 16 - 13.12.26	805 000	EUR	785 454	789 552	0,02
			580 345 750	581 103 401	15,03
Total - Obligations			3 794 281 226	3 817 992 304	98,78

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds communs de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	164	EUR	1 645 785	1 648 138	0,04
			1 645 785	1 648 138	0,04
Luxembourg					
Xtrackers II EUR Corporate Bond SRI PAB UCITS ETF	8	EUR	1 064	1 122	0,00
			1 064	1 122	0,00
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			1 646 849	1 649 260	0,04
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			3 795 928 075	3 819 641 564	98,82
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			3 795 928 075	3 819 641 564	98,82
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				3 864 549 384	99,98

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	30 156 339	EUR	28 273 893	28 547 800	2,24
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	27 232 000	EUR	24 054 834	24 531 947	1,92
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	36 995 000	EUR	19 853 543	20 659 858	1,62
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	25 848 000	EUR	22 574 282	23 071 925	1,81
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	21 063 000	EUR	20 349 932	20 345 594	1,59
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	22 085 000	EUR	17 011 620	17 422 415	1,36
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	19 914 000	EUR	18 246 927	18 472 226	1,45
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	31 000 000	EUR	26 769 890	27 411 750	2,15
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	25 319 000	EUR	24 166 854	24 285 985	1,90
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	8 690 000	EUR	7 501 024	7 670 402	0,60
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	6 855 000	EUR	6 541 034	6 589 711	0,52
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.02.31	25 888 000	EUR	22 122 342	22 650 964	1,77
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	25 848 000	EUR	24 430 354	24 594 889	1,93
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.05.36	23 679 000	EUR	17 668 633	18 185 709	1,42
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.11.28	25 020 000	EUR	22 432 110	22 834 503	1,79
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	8 733 000	EUR	4 745 489	4 887 030	0,38
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	29 660 000	EUR	25 035 472	25 690 602	2,01
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	22 218 000	EUR	20 803 867	20 964 683	1,64
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	27 297 000	EUR	13 633 089	14 571 957	1,14
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	8 291 000	EUR	7 014 610	7 178 214	0,56
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.02.32	28 677 000	EUR	23 818 890	24 552 961	1,92
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 16.04.27	20 464 000	EUR	18 951 258	19 167 606	1,50
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.10.27	27 638 000	EUR	26 454 643	26 976 899	2,11
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	28 269 943	EUR	26 431 087	26 769 374	2,10
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	27 064 000	EUR	24 638 893	25 120 805	1,97

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.25% 19 - 15.02.29	27 177 000	EUR	24 533 373	25 047 138	1,96
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	27 903 975	EUR	27 183 943	27 184 331	2,13
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	30 676 943	EUR	29 374 706	29 552 633	2,31
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	29 871 339	EUR	27 967 009	28 353 576	2,22
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	26 308 611	EUR	24 451 189	24 840 854	1,95
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	28 399 975	EUR	27 638 675	27 711 560	2,17
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 22 - 15.05.38	20 002 000	EUR	16 104 748	17 028 903	1,33
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	34 677 599	EUR	27 263 336	28 202 944	2,21
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	7 742 000	EUR	7 399 916	7 578 412	0,59
Bundesrepublik Deutschland 1.70% 22 - 15.08.32	25 848 000	EUR	24 435 771	25 326 129	1,98
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 22 - 15.08.53	24 002 000	EUR	19 646 605	21 693 728	1,70
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	4 997 000	EUR	4 193 705	4 525 833	0,36
Bundesrepublik Deutschland 2.10% 22 - 15.11.29	24 064 000	EUR	23 519 121	24 304 881	1,90
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 23 - 13.04.28	22 782 000	EUR	22 438 512	22 992 563	1,80
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	35 054 000	EUR	34 381 833	35 969 260	2,82
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	5 663 000	EUR	5 577 482	5 815 335	0,46
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 19.10.28	26 799 000	EUR	26 532 182	27 354 543	2,14
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 15.11.30	12 189 000	EUR	12 093 370	12 555 401	0,98
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 04.07.44	28 301 339	EUR	28 547 989	29 289 056	2,29
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	28 883 878	EUR	29 312 484	30 039 522	2,35
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	16 038 000	EUR	15 920 391	15 976 414	1,25
Bundesrepublik Deutschland 2.60% 23 - 15.08.33	28 465 000	EUR	28 522 512	29 921 269	2,34
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	16 238 000	EUR	16 173 177	16 265 694	1,27
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	15 490 000	EUR	15 493 789	15 641 647	1,23
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	13 511 000	EUR	13 600 892	13 686 238	1,07
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 04.07.42	17 955 837	EUR	20 016 234	20 536 270	1,61
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 04.01.37	25 842 975	EUR	30 241 907	31 128 380	2,44
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 04.07.39	17 849 074	EUR	21 915 288	22 485 728	1,76
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 04.07.28	12 779 338	EUR	14 107 763	14 315 287	1,12
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 04.07.34	22 654 007	EUR	27 606 414	28 371 199	2,22
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	19 667 000	EUR	25 787 599	26 352 600	2,06
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	155 438	EUR	201 882	208 278	0,02
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 04.01.31	19 737 042	EUR	23 852 921	24 329 852	1,91
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 04.01.28	15 615 376	EUR	17 551 313	17 794 814	1,39
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 04.01.30	10 681 971	EUR	13 058 080	13 282 390	1,04
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 04.07.27	12 693 338	EUR	14 445 272	14 591 119	1,14
			1 234 615 953	1 263 409 590	98,92
Total - Obligations			1 234 615 953	1 263 409 590	98,92

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	27	EUR	271 014	271 340	0,02
			271 014	271 340	0,02
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			271 014	271 340	0,02
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 234 886 967	1 263 680 930	98,94
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 234 886 967	1 263 680 930	98,94
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 275 065 261	99,83

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

Xtrackers II

Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	4 389 000	EUR	4 096 779	4 154 891	10,40
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	3 106 000	EUR	3 026 746	3 000 210	7,51
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	3 714 000	EUR	3 561 968	3 562 469	8,92
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	1 013 000	EUR	971 285	973 797	2,44
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	3 781 000	EUR	3 571 228	3 597 697	9,01
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	3 241 000	EUR	3 006 825	3 058 175	7,66
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	4 108 000	EUR	4 045 432	4 002 055	10,02
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	4 524 000	EUR	4 312 178	4 358 195	10,91
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	4 119 000	EUR	4 042 150	4 019 155	10,06
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	2 363 000	EUR	2 351 778	2 353 926	5,89
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	2 363 000	EUR	2 358 865	2 367 030	5,93
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	2 296 000	EUR	2 297 394	2 318 478	5,80
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	1 958 000	EUR	1 971 624	1 983 395	4,96
			39 614 252	39 749 473	99,51
Total - Obligations			39 614 252	39 749 473	99,51
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	2	EUR	20 053	20 099	0,05
			20 053	20 099	0,05
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			20 053	20 099	0,05
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			39 634 305	39 769 572	99,56
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			39 634 305	39 769 572	99,56
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				39 990 161	100,11

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Aurizon Network Pty Ltd. 3.125% 16 - 01.06.26	790 000	EUR	782 138	782 653	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 21 - 05.05.31	1 048 000	EUR	963 711	960 240	0,04
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0.75% 16 - 29.09.26	1 070 000	EUR	1 038 270	1 004 334	0,04
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3.652% 23 - 20.01.26	1 000 000	EUR	994 087	1 007 440	0,04
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 23 - 03.02.33	1 300 000	EUR	1 294 257	1 336 049	0,06
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd. 4.375% 23 - 24.05.33	700 000	EUR	701 288	740 411	0,03
CIMIC Finance Ltd. 1.50% 21 - 28.05.29	930 000	EUR	807 708	807 324	0,03
Commonwealth Bank of Australia 1.125% 18 - 18.01.28	610 000	EUR	588 792	572 137	0,02
Goodman Australia Finance Pty Ltd. 1.375% 17 - 27.09.25	670 000	EUR	647 258	647 582	0,03
National Australia Bank Ltd. 1.125% 19 - 20.05.31	451 000	EUR	412 482	404 069	0,02
National Australia Bank Ltd. 1.25% 16 - 18.05.26	1 040 000	EUR	1 035 269	1 003 309	0,04
National Australia Bank Ltd. 1.375% 18 - 30.08.28	1 440 000	EUR	1 424 449	1 331 366	0,06
National Australia Bank Ltd. 2.125% 22 - 24.05.28	1 370 000	EUR	1 339 676	1 322 913	0,06
Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 1.45% 19 - 28.03.29	600 000	EUR	532 676	528 594	0,02
Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 1.75% 18 - 11.04.28	570 000	EUR	526 487	519 452	0,02
Stockland Trust 1.625% 18 - 27.04.26	310 000	EUR	292 444	294 385	0,01
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 18 - 26.04.28	900 000	EUR	822 741	846 702	0,04
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 4.375% 23 - 03.05.33	1 450 000	EUR	1 446 413	1 525 211	0,06
Telstra Corp. Ltd. 1.00% 20 - 23.04.30	743 000	EUR	683 307	661 872	0,03
Telstra Corp. Ltd. 1.125% 16 - 14.04.26	970 000	EUR	952 672	929 920	0,04
Telstra Corp. Ltd. 1.375% 19 - 26.03.29	940 000	EUR	870 795	868 475	0,04
Telstra Group Ltd. 3.75% 23 - 04.05.31	760 000	EUR	759 408	796 807	0,03
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.45% 19 - 16.05.29	980 000	EUR	904 439	892 702	0,04
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 17 - 29.03.28	800 000	EUR	766 432	753 664	0,03
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 2.00% 15 - 28.08.25	690 000	EUR	677 136	674 151	0,03
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 3.00% 20 - 08.04.30	980 000	EUR	981 354	958 832	0,04
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 4.225% 23 - 26.04.33	990 000	EUR	994 108	1 041 955	0,04
Vicinity Centres Trust 1.125% 19 - 07.11.29	580 000	EUR	510 646	491 672	0,02
Wesfarmers Ltd. 0.954% 21 - 21.10.33	900 000	EUR	742 206	724 050	0,03
Westpac Banking Corp. FRN 21 - 13.05.31	1 209 000	EUR	1 153 032	1 108 218	0,05
Westpac Banking Corp. 0.875% 16 - 17.04.27	770 000	EUR	723 517	714 522	0,03
Westpac Banking Corp. 1.125% 17 - 05.09.27	907 000	EUR	870 525	843 392	0,03
Westpac Banking Corp. 1.45% 18 - 17.07.28	990 000	EUR	966 876	923 106	0,04
Westpac Banking Corp. 3.703% 23 - 16.01.26	1 200 000	EUR	1 193 175	1 210 524	0,05
Westpac Banking Corp. 3.799% 23 - 17.01.30	600 000	EUR	599 905	618 360	0,03
Woolworths Group Ltd. 0.375% 21 - 15.11.28	700 000	EUR	614 699	601 818	0,02
			30 614 378	30 448 211	1,27

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
A1 Towers Holding GmbH 5.25% 23 - 13.07.28	800 000	EUR	816 843	846 680	0,04
BAWAG Group AG FRN 23 - 24.02.34	500 000	EUR	499 281	509 510	0,02
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0.375% 19 - 03.09.27	400 000	EUR	370 448	359 848	0,01
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 4.125% 23 - 18.01.27	700 000	EUR	696 320	709 877	0,03
CA Immobilien Anlagen AG 0.875% 20 - 05.02.27	500 000	EUR	450 765	444 980	0,02
CA Immobilien Anlagen AG 1.00% 20 - 27.10.25	500 000	EUR	465 903	457 465	0,02
Erste Group Bank AG 0.05% 20 - 16.09.25	600 000	EUR	579 411	567 120	0,02
Erste Group Bank AG FRN 20 - 16.11.28	700 000	EUR	640 447	618 009	0,03
Erste Group Bank AG 0.125% 21 - 17.05.28	400 000	EUR	369 080	350 928	0,01
Erste Group Bank AG 0.25% 21 - 27.01.31	500 000	EUR	411 153	407 580	0,02
Erste Group Bank AG 0.25% 21 - 14.09.29	500 000	EUR	425 778	421 520	0,02
Erste Group Bank AG 0.875% 19 - 22.05.26	700 000	EUR	679 384	663 096	0,03
Erste Group Bank AG 0.875% 20 - 13.05.27	1 000 000	EUR	969 762	926 970	0,04
Erste Group Bank AG FRN 21 - 15.11.32	600 000	EUR	521 631	524 388	0,02
Erste Group Bank AG FRN 19 - 10.06.30	500 000	EUR	481 268	471 695	0,02
Erste Group Bank AG 1.50% 22 - 07.04.26	700 000	EUR	678 723	673 624	0,03
Erste Group Bank AG FRN 20 - 08.09.31	500 000	EUR	467 090	466 530	0,02
Erste Group Bank AG FRN 22 - 07.06.33	800 000	EUR	757 674	786 656	0,03
Erste Group Bank AG FRN 23 - 16.01.31	800 000	EUR	795 191	827 912	0,03
Erste Group Bank AG FRN 23 - 30.05.30	700 000	EUR	701 062	726 502	0,03
Mondi Finance Europe GmbH 2.375% 20 - 01.04.28	980 000	EUR	955 110	960 243	0,04
Raiffeisen Bank International AG 0.05% 21 - 01.09.27	500 000	EUR	458 111	435 920	0,02
Raiffeisen Bank International AG 0.25% 20 - 22.01.25	800 000	EUR	786 154	769 304	0,03
Raiffeisen Bank International AG 0.375% 19 - 25.09.26	1 000 000	EUR	935 593	914 420	0,04
Raiffeisen Bank International AG FRN 21 - 17.06.33	600 000	EUR	471 696	490 578	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 19 - 12.03.30	600 000	EUR	542 224	559 230	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 20 - 18.06.32	500 000	EUR	431 062	448 045	0,02
Raiffeisen Bank International AG 4.125% 22 - 08.09.25	500 000	EUR	496 504	502 795	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 23 - 26.01.27	1 100 000	EUR	1 094 180	1 112 199	0,05
Raiffeisen Bank International AG 5.75% 22 - 27.01.28	700 000	EUR	714 472	748 979	0,03
Raiffeisen Bank International AG FRN 23 - 15.09.28	500 000	EUR	499 558	521 630	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 22 - 20.12.32	700 000	EUR	694 608	736 694	0,03
Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 16 - 07.12.26	1 000 000	EUR	997 989	963 350	0,04
UNIQA Insurance Group AG 1.375% 20 - 09.07.30	700 000	EUR	679 027	606 494	0,03
UNIQA Insurance Group AG FRN 21 - 09.12.41	400 000	EUR	342 519	323 832	0,01
UNIQA Insurance Group AG FRN 15 - 27.07.46	300 000	EUR	321 628	307 674	0,01
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe 1.00% 21 - 26.03.36	600 000	EUR	456 920	479 922	0,02
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 22 - 15.06.42	600 000	EUR	558 250	601 896	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Wienerberger AG 2.75% 20 - 04.06.25	500 000	EUR	489 516	491 225	0,02
Wienerberger AG 4.875% 23 - 04.10.28	519 000	EUR	517 041	550 145	0,02
			24 219 376	24 285 465	1,01
Belgique					
Aedifica SA 0.75% 21 - 09.09.31	600 000	EUR	471 266	477 282	0,02
AG Insurance SA FRN 15 - 30.06.47	500 000	EUR	477 349	479 900	0,02
Ageas SA FRN 20 - 24.11.51	600 000	EUR	502 926	480 114	0,02
Ageas SA FRN 19 - 02.07.49	500 000	EUR	497 672	466 730	0,02
Cofinimmo SA 0.875% 20 - 02.12.30	600 000	EUR	526 601	487 056	0,02
Cofinimmo SA 1.00% 22 - 24.01.28	500 000	EUR	456 765	452 740	0,02
Elia Group SA 1.50% 18 - 05.09.28	300 000	EUR	274 349	278 946	0,01
Elia Transmission Belgium SA 0.875% 20 - 28.04.30	1 200 000	EUR	1 087 667	1 046 076	0,04
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 19 - 14.01.26	800 000	EUR	774 394	769 144	0,03
Elia Transmission Belgium SA 3.00% 14 - 07.04.29	400 000	EUR	404 362	396 244	0,02
Elia Transmission Belgium SA 3.25% 13 - 04.04.28	1 000 000	EUR	1 040 144	1 009 070	0,04
Elia Transmission Belgium SA 3.625% 23 - 18.01.33	700 000	EUR	687 831	722 449	0,03
Groupe Bruxelles Lambert NV 0.125% 21 - 28.01.31	700 000	EUR	583 961	563 556	0,02
Groupe Bruxelles Lambert NV 1.875% 18 - 19.06.25	700 000	EUR	704 270	684 439	0,03
Groupe Bruxelles Lambert NV 3.125% 22 - 06.09.29	700 000	EUR	678 801	702 051	0,03
Groupe Bruxelles Lambert NV 4.00% 23 - 15.05.33	800 000	EUR	803 536	840 920	0,04
KBC Group NV FRN 20 - 10.09.26	1 000 000	EUR	949 841	942 970	0,04
KBC Group NV FRN 21 - 14.01.29	1 000 000	EUR	915 872	875 050	0,04
KBC Group NV FRN 21 - 01.03.27	1 300 000	EUR	1 263 585	1 215 838	0,05
KBC Group NV FRN 20 - 16.06.27	600 000	EUR	566 720	558 900	0,02
KBC Group NV FRN 21 - 07.12.31	1 000 000	EUR	905 217	902 500	0,04
KBC Group NV 0.75% 20 - 24.01.30	400 000	EUR	359 932	343 504	0,01
KBC Group NV 0.75% 21 - 31.05.31	600 000	EUR	491 655	503 088	0,02
KBC Group NV FRN 22 - 21.01.28	800 000	EUR	769 797	736 128	0,03
KBC Group NV FRN 22 - 29.03.26	700 000	EUR	689 068	680 967	0,03
KBC Group NV 3.00% 22 - 25.08.30	1 000 000	EUR	972 184	974 460	0,04
KBC Group NV FRN 23 - 28.11.29	600 000	EUR	596 982	616 476	0,03
KBC Group NV FRN 22 - 23.11.27	1 200 000	EUR	1 212 937	1 228 188	0,05
KBC Group NV FRN 23 - 19.04.30	1 300 000	EUR	1 305 642	1 349 413	0,06
KBC Group NV 4.375% 23 - 06.12.31	800 000	EUR	799 348	842 696	0,04
KBC Group NV FRN 23 - 06.06.26	1 400 000	EUR	1 396 062	1 415 162	0,06
KBC Group NV FRN 23 - 25.04.33	600 000	EUR	592 319	613 308	0,03
Lonza Finance International NV 1.625% 20 - 21.04.27	583 000	EUR	573 052	558 747	0,02
Lonza Finance International NV 3.875% 23 - 25.05.33	850 000	EUR	843 730	881 892	0,04
Solvay SA 2.75% 15 - 02.12.27	800 000	EUR	797 026	784 896	0,03
Syensqo SA FRN 20 - 31.12.99	600 000	EUR	571 602	569 334	0,02
VGP NV 1.50% 21 - 08.04.29	700 000	EUR	507 330	543 669	0,02
VGP NV 1.625% 22 - 17.01.27	600 000	EUR	497 870	525 474	0,02
VGP NV 2.25% 22 - 17.01.30	600 000	EUR	430 905	472 008	0,02
			27 980 570	27 991 385	1,17
Canada					
Bank of Montreal 2.75% 22 - 15.06.27	780 000	EUR	763 719	767 231	0,03
Bank of Nova Scotia 0.125% 19 - 04.09.26	990 000	EUR	927 144	914 018	0,04
Bank of Nova Scotia 0.25% 21 - 01.11.28	760 000	EUR	663 645	659 703	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Great-West Lifeco Inc. 1.75% 16 - 07.12.26	680 000	EUR	664 136	660 171	0,03
Great-West Lifeco Inc. 4.70% 22 - 16.11.29	600 000	EUR	622 780	643 080	0,03
Magna International Inc. 1.50% 17 - 25.09.27	940 000	EUR	890 030	896 600	0,04
Magna International Inc. 4.375% 23 - 17.03.32	800 000	EUR	813 287	852 784	0,04
National Bank of Canada 3.75% 23 - 25.01.28	500 000	EUR	490 857	506 045	0,02
Royal Bank of Canada 2.125% 22 - 26.04.29	1 300 000	EUR	1 242 569	1 225 016	0,05
Royal Bank of Canada 4.125% 23 - 05.07.28	900 000	EUR	895 631	928 647	0,04
Royal Bank of Canada 4.375% 23 - 02.10.30	940 000	EUR	935 996	988 119	0,04
Toronto-Dominion Bank 0.50% 22 - 18.01.27	1 120 000	EUR	1 065 793	1 036 930	0,04
Toronto-Dominion Bank 1.952% 22 - 08.04.30	1 790 000	EUR	1 657 482	1 643 130	0,07
Toronto-Dominion Bank 2.551% 22 - 03.08.27	1 100 000	EUR	1 078 375	1 076 229	0,04
Toronto-Dominion Bank 3.129% 22 - 03.08.32	1 500 000	EUR	1 480 963	1 467 090	0,06
Toronto-Dominion Bank 3.631% 22 - 13.12.29	1 520 000	EUR	1 490 884	1 537 845	0,06
			15 683 291	15 802 638	0,66
Croatie					
Erste & Steiermaerkische Bank FRN 21 - 06.07.28	400 000	EUR	346 421	343 828	0,02
Raiffeisenbank Austria dd FRN 23 - 05.06.27	300 000	EUR	307 784	316 866	0,01
			654 205	660 694	0,03
République tchèque					
Ceska sporitelna AS FRN 21 - 13.09.28	400 000	EUR	358 482	345 884	0,01
Ceska sporitelna AS FRN 23 - 08.03.28	700 000	EUR	704 060	722 617	0,03
Ceska sporitelna AS FRN 23 - 29.06.27	600 000	EUR	603 103	622 362	0,03
Raiffeisenbank AS FRN 21 - 09.06.28	300 000	EUR	265 826	258 132	0,01
Raiffeisenbank AS FRN 23 - 19.01.26	600 000	EUR	603 316	606 462	0,03
			2 534 787	2 555 457	0,11
Danemark					
AP Moller - Maersk A/S 0.75% 21 - 25.11.31	720 000	EUR	599 995	589 738	0,02
AP Moller - Maersk A/S 1.75% 18 - 16.03.26	1 030 000	EUR	1 004 014	996 824	0,04
Danica Pension Livsforsikrings AB FRN 15 - 29.09.45	480 000	EUR	502 154	474 048	0,02
Danske Bank A/S 0.625% 20 - 26.05.25	1 030 000	EUR	1 009 359	990 139	0,04
Danske Bank A/S FRN 21 - 09.06.29	430 000	EUR	388 288	380 662	0,02
Danske Bank A/S FRN 21 - 15.05.31	880 000	EUR	815 396	821 110	0,03
Danske Bank A/S FRN 19 - 12.02.30	800 000	EUR	769 576	771 304	0,03
Danske Bank A/S FRN 22 - 17.02.27	900 000	EUR	855 435	857 646	0,04
Danske Bank A/S FRN 20 - 02.09.30	760 000	EUR	715 050	724 880	0,03
Danske Bank A/S FRN 23 - 12.01.27	1 100 000	EUR	1 098 183	1 108 690	0,05
Danske Bank A/S FRN 23 - 10.01.31	1 250 000	EUR	1 250 850	1 295 050	0,05
Danske Bank A/S FRN 23 - 09.11.28	686 000	EUR	692 670	707 883	0,03
Danske Bank A/S FRN 23 - 21.06.30	1 200 000	EUR	1 196 671	1 265 316	0,05
DSV A/S 0.375% 20 - 26.02.27	750 000	EUR	694 959	690 938	0,03
H Lundbeck A/S 0.875% 20 - 14.10.27	680 000	EUR	616 699	615 992	0,03
ISS Global A/S 0.875% 19 - 18.06.26	680 000	EUR	663 103	637 541	0,03
ISS Global A/S 1.50% 17 - 31.08.27	940 000	EUR	891 753	877 565	0,04
Jyske Bank A/S FRN 21 - 02.09.26	720 000	EUR	668 525	676 174	0,03
Jyske Bank A/S FRN 21 - 17.02.28	360 000	EUR	321 662	326 758	0,01
Jyske Bank A/S FRN 22 - 11.04.26	630 000	EUR	630 323	635 670	0,03
Jyske Bank A/S FRN 23 - 10.11.29	640 000	EUR	638 400	665 978	0,03
Jyske Bank A/S FRN 23 - 26.10.28	600 000	EUR	600 483	623 856	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Danemark (suite)					
Jyske Bank A/S 5.50% 22 - 16.11.27	520 000	EUR	522 318	545 464	0,02
Nykredit Realkredit AS 0.25% 20 - 13.01.26	990 000	EUR	935 054	929 600	0,04
Nykredit Realkredit AS 0.375% 21 - 17.01.28	880 000	EUR	791 242	774 990	0,03
Nykredit Realkredit AS 0.50% 20 - 10.07.25	800 000	EUR	774 088	764 816	0,03
Nykredit Realkredit AS 0.625% 19 - 17.01.25	500 000	EUR	491 402	484 750	0,02
Nykredit Realkredit AS 0.75% 20 - 20.01.27	892 000	EUR	839 094	820 720	0,03
Nykredit Realkredit AS FRN 21 - 28.07.31	500 000	EUR	449 692	456 110	0,02
Nykredit Realkredit AS 1.375% 22 - 12.07.27	770 000	EUR	725 894	720 666	0,03
Nykredit Realkredit AS 4.00% 23 - 17.07.28	850 000	EUR	829 672	860 761	0,04
Nykredit Realkredit AS 4.625% 23 - 19.01.29	1 000 000	EUR	1 010 940	1 033 610	0,04
Nykredit Realkredit AS FRN 22 - 29.12.32	500 000	EUR	493 479	515 905	0,02
Pandora A/S 4.50% 23 - 10.04.28	720 000	EUR	725 745	747 252	0,03
Sydbank AS FRN 21 - 10.11.26	570 000	EUR	536 021	534 614	0,02
Sydbank AS FRN 23 - 06.09.28	620 000	EUR	617 167	640 454	0,03
TDC Net A/S 5.056% 22 - 31.05.28	660 000	EUR	645 080	685 885	0,03
TDC Net A/S 5.618% 23 - 06.02.30	700 000	EUR	689 166	721 231	0,03
TDC Net A/S 6.50% 23 - 01.06.31	750 000	EUR	746 953	794 557	0,03
Vestas Wind Systems A/S 4.125% 23 - 15.06.26	720 000	EUR	725 279	732 002	0,03
Vestas Wind Systems A/S 4.125% 23 - 15.06.31	738 000	EUR	735 569	761 616	0,03
			29 907 403	30 258 765	1,26
Estonie					
Luminor Bank AS FRN 21 - 23.09.26	400 000	EUR	358 532	367 260	0,01
Luminor Bank AS FRN 23 - 16.01.26	400 000	EUR	402 084	407 400	0,02
Luminor Bank AS FRN 23 - 08.06.27	200 000	EUR	203 013	210 794	0,01
			963 629	985 454	0,04
Finlande					
Castellum Helsinki Finance Holdings Abp 0.875% 21 - 17.09.29	740 000	EUR	593 762	570 784	0,02
Castellum Helsinki Finance Holdings Abp 2.00% 22 - 24.03.25	630 000	EUR	608 272	607 956	0,03
Elisa OYJ 0.25% 20 - 15.09.27	340 000	EUR	314 073	308 050	0,01
Elisa OYJ 1.125% 19 - 26.02.26	380 000	EUR	365 951	364 374	0,02
Elisa OYJ 4.00% 23 - 27.01.29	490 000	EUR	487 993	507 371	0,02
Kojamo OYJ 0.875% 21 - 28.05.29	330 000	EUR	277 129	261 169	0,01
Kojamo OYJ 1.625% 18 - 07.03.25	454 000	EUR	436 864	434 664	0,02
Kojamo OYJ 1.875% 20 - 27.05.27	640 000	EUR	594 332	572 122	0,02
Kojamo OYJ 2.00% 22 - 31.03.26	300 000	EUR	282 151	280 107	0,01
Metso Outotec OYJ 0.875% 20 - 26.05.28	300 000	EUR	266 224	268 539	0,01
Metso Outotec OYJ 4.875% 22 - 07.12.27	510 000	EUR	517 619	535 199	0,02
Metso OYJ 4.375% 23 - 22.11.30	443 000	EUR	444 748	457 783	0,02
Nokia OYJ 2.00% 19 - 11.03.26	900 000	EUR	860 385	866 997	0,04
Nokia OYJ 3.125% 20 - 15.05.28	200 000	EUR	188 576	195 520	0,01
Nokia OYJ 4.375% 23 - 21.08.31	1 000 000	EUR	980 394	1 005 330	0,04
Nordea Bank Abp 0.375% 19 - 28.05.26	800 000	EUR	778 822	751 584	0,03
Nordea Bank Abp 0.50% 20 - 14.05.27	1 340 000	EUR	1 286 350	1 237 088	0,05
Nordea Bank Abp 0.50% 21 - 19.03.31	600 000	EUR	490 012	500 682	0,02
Nordea Bank Abp 0.50% 21 - 02.11.28	1 070 000	EUR	964 843	939 867	0,04
Nordea Bank Abp 1.125% 15 - 12.02.25	1 340 000	EUR	1 330 584	1 306 004	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Nordea Bank Abp 1.125% 17 - 27.09.27	1 030 000	EUR	1 015 120	972 371	0,04
Nordea Bank Abp 1.125% 22 - 16.02.27	1 310 000	EUR	1 254 334	1 230 575	0,05
Nordea Bank Abp 2.50% 22 - 23.05.29	1 240 000	EUR	1 196 665	1 192 545	0,05
Nordea Bank Abp 2.875% 22 - 24.08.32	850 000	EUR	788 066	823 497	0,03
Nordea Bank Abp FRN 23 - 10.02.26	1 150 000	EUR	1 141 959	1 147 021	0,05
Nordea Bank Abp 4.125% 23 - 05.05.28	1 200 000	EUR	1 200 474	1 238 820	0,05
Nordea Bank Abp FRN 23 - 06.09.26	1 320 000	EUR	1 322 464	1 336 711	0,06
Nordea Bank Abp FRN 23 - 23.02.34	486 000	EUR	493 853	505 051	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.10% 20 - 16.11.27	1 240 000	EUR	1 148 553	1 104 232	0,05
OP Corporate Bank PLC 0.25% 21 - 24.03.26	700 000	EUR	659 725	653 744	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.375% 21 - 16.06.28	700 000	EUR	646 709	617 071	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.375% 21 - 08.12.28	760 000	EUR	658 465	657 020	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.50% 20 - 12.08.25	1 150 000	EUR	1 119 352	1 098 457	0,05
OP Corporate Bank PLC 0.60% 20 - 18.01.27	617 000	EUR	581 558	566 091	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.625% 19 - 12.11.29	400 000	EUR	356 134	342 824	0,01
OP Corporate Bank PLC 0.625% 22 - 27.07.27	660 000	EUR	597 665	599 399	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.75% 21 - 24.03.31	200 000	EUR	160 588	169 956	0,01
OP Corporate Bank PLC 1.00% 18 - 22.05.25	580 000	EUR	569 455	560 605	0,02
OP Corporate Bank PLC FRN 20 - 09.06.30	1 073 000	EUR	1 028 430	1 025 445	0,04
OP Corporate Bank PLC 2.875% 22 - 15.12.25	1 440 000	EUR	1 421 826	1 432 786	0,06
OP Corporate Bank PLC 4.00% 23 - 13.06.28	700 000	EUR	699 955	723 261	0,03
OP Corporate Bank PLC 4.125% 22 - 18.04.27	520 000	EUR	523 902	534 908	0,02
Sampo OYJ 1.625% 18 - 21.02.28	330 000	EUR	316 797	318 780	0,01
Sampo OYJ 2.25% 18 - 27.09.30	400 000	EUR	375 936	393 308	0,02
Sampo OYJ FRN 20 - 03.09.52	1 150 000	EUR	1 058 399	966 403	0,04
Sampo OYJ FRN 19 - 23.05.49	620 000	EUR	589 926	583 556	0,02
Stora Enso OYJ 0.625% 20 - 02.12.30	650 000	EUR	565 169	529 146	0,02
Stora Enso OYJ 2.50% 17 - 07.06.27	380 000	EUR	385 357	371 492	0,02
Stora Enso OYJ 2.50% 18 - 21.03.28	550 000	EUR	535 694	528 919	0,02
Stora Enso OYJ 4.00% 23 - 01.06.26	760 000	EUR	757 343	768 717	0,03
Stora Enso OYJ 4.25% 23 - 01.09.29	730 000	EUR	731 522	748 513	0,03
			35 970 479	35 712 414	1,49
France					
Accor SA 2.375% 21 - 29.11.28	1 000 000	EUR	904 975	953 210	0,04
Accor SA 3.00% 19 - 04.02.26	800 000	EUR	762 812	769 216	0,03
Air Liquide Finance SA 0.375% 21 - 27.05.31	700 000	EUR	609 714	590 674	0,02
Air Liquide Finance SA 0.375% 21 - 20.09.33	600 000	EUR	497 306	474 312	0,02
Air Liquide Finance SA 0.625% 19 - 20.06.30	1 000 000	EUR	928 919	876 050	0,04
Air Liquide Finance SA 1.00% 17 - 08.03.27	800 000	EUR	789 054	761 768	0,03
Air Liquide Finance SA 1.00% 20 - 02.04.25	600 000	EUR	583 932	583 500	0,02
Air Liquide Finance SA 1.25% 15 - 03.06.25	700 000	EUR	695 433	682 626	0,03
Air Liquide Finance SA 1.25% 16 - 13.06.28	1 400 000	EUR	1 365 810	1 332 996	0,06
Air Liquide Finance SA 1.375% 20 - 02.04.30	800 000	EUR	759 234	736 624	0,03
Air Liquide Finance SA 2.875% 22 - 16.09.32	1 000 000	EUR	967 066	996 930	0,04
ALD SA 1.25% 22 - 02.03.26	800 000	EUR	764 400	763 384	0,03
ALD SA 4.00% 22 - 05.07.27	400 000	EUR	400 960	408 756	0,02
ALD SA 4.25% 23 - 18.01.27	900 000	EUR	899 760	920 097	0,04
ALD SA 4.375% 23 - 23.11.26	600 000	EUR	606 108	614 640	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
ALD SA 4.75% 22 - 13.10.25	800 000	EUR	803 050	815 576	0,03
ALD SA 4.875% 23 - 06.10.28	1 300 000	EUR	1 305 748	1 376 245	0,06
Alstom SA Zero Coupon 21 - 11.01.29	1 100 000	EUR	972 069	906 070	0,04
Alstom SA 0.125% 21 - 27.07.27	900 000	EUR	824 516	789 678	0,03
Alstom SA 0.25% 19 - 14.10.26	900 000	EUR	862 440	815 274	0,03
Alstom SA 0.50% 21 - 27.07.30	1 000 000	EUR	860 673	810 290	0,03
Altarea SCA 1.75% 20 - 16.01.30	400 000	EUR	314 160	307 788	0,01
Altarea SCA 1.875% 19 - 17.01.28	500 000	EUR	438 198	419 535	0,02
APRR SA Zero Coupon 21 - 19.06.28	800 000	EUR	731 871	707 400	0,03
APRR SA 0.125% 20 - 18.01.29	700 000	EUR	629 534	611 555	0,03
APRR SA 1.125% 16 - 09.01.26	1 000 000	EUR	971 553	964 940	0,04
APRR SA 1.25% 16 - 06.01.27	600 000	EUR	590 333	572 316	0,02
APRR SA 1.25% 19 - 18.01.28	800 000	EUR	771 221	752 192	0,03
APRR SA 1.25% 20 - 14.01.27	700 000	EUR	682 847	666 792	0,03
APRR SA 1.50% 17 - 17.01.33	1 000 000	EUR	927 409	877 090	0,04
APRR SA 1.50% 18 - 25.01.30	600 000	EUR	557 059	552 702	0,02
APRR SA 1.625% 17 - 13.01.32	700 000	EUR	664 562	632 401	0,03
APRR SA 1.875% 14 - 15.01.25	1 000 000	EUR	1 003 036	981 580	0,04
APRR SA 1.875% 16 - 06.01.31	800 000	EUR	799 631	744 920	0,03
APRR SA 1.875% 22 - 03.01.29	700 000	EUR	670 860	666 792	0,03
APRR SA 3.125% 23 - 24.01.30	1 200 000	EUR	1 230 763	1 209 456	0,05
Arkema SA 0.125% 20 - 14.10.26	500 000	EUR	466 200	462 395	0,02
Arkema SA 0.75% 19 - 03.12.29	700 000	EUR	610 236	611 786	0,03
Arkema SA 1.50% 15 - 20.01.25	900 000	EUR	895 747	880 605	0,04
Arkema SA 1.50% 17 - 20.04.27	1 400 000	EUR	1 361 617	1 333 626	0,06
Arkema SA FRN 20 - 31.12.99	400 000	EUR	354 819	370 000	0,02
Arkema SA 3.50% 23 - 23.01.31	600 000	EUR	580 573	601 236	0,03
Arkema SA 4.25% 23 - 20.05.30	1 100 000	EUR	1 106 810	1 148 400	0,05
Arval Service Lease SA Zero Coupon 21 - 01.10.25	700 000	EUR	669 668	658 294	0,03
Arval Service Lease SA 0.875% 22 - 17.02.25	800 000	EUR	785 623	773 416	0,03
Arval Service Lease SA 3.375% 22 - 04.01.26	700 000	EUR	733 391	699 279	0,03
Arval Service Lease SA 4.00% 22 - 22.09.26	900 000	EUR	891 135	911 529	0,04
Arval Service Lease SA 4.125% 23 - 13.04.26	1 000 000	EUR	996 037	1 011 820	0,04
Arval Service Lease SA 4.25% 23 - 11.11.25	1 000 000	EUR	1 000 659	1 011 340	0,04
Arval Service Lease SA 4.75% 22 - 22.05.27	500 000	EUR	508 011	518 785	0,02
Autoroutes du Sud de la France SA 1.00% 16 - 13.05.26	700 000	EUR	680 175	668 773	0,03
Autoroutes du Sud de la France SA 1.125% 17 - 20.04.26	800 000	EUR	790 505	767 712	0,03
Autoroutes du Sud de la France SA 1.25% 17 - 18.01.27	1 300 000	EUR	1 259 584	1 240 395	0,05
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 22.01.30	1 500 000	EUR	1 452 789	1 378 440	0,06
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 27.06.28	1 100 000	EUR	1 074 367	1 036 805	0,04
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 19 - 21.02.31	1 500 000	EUR	1 412 278	1 347 855	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.75% 22 - 02.09.32	1 400 000	EUR	1 328 494	1 358 798	0,06
Autoroutes du Sud de la France SA 3.25% 23 - 19.01.33	1 000 000	EUR	985 590	1 005 650	0,04
AXA SA 1.125% 16 - 15.05.28	420 000	EUR	405 229	394 246	0,02
AXA SA FRN 21 - 07.10.41	1 140 000	EUR	946 062	941 594	0,04
AXA SA FRN 22 - 10.07.42	1 360 000	EUR	1 164 905	1 118 559	0,05
AXA SA FRN 18 - 28.05.49	2 290 000	EUR	2 284 747	2 195 973	0,09
AXA SA FRN 16 - 06.07.47	1 802 000	EUR	1 822 332	1 764 158	0,07
AXA SA 3.625% 23 - 10.01.33	800 000	EUR	794 391	846 928	0,04
AXA SA 3.75% 22 - 12.10.30	1 080 000	EUR	1 088 045	1 138 968	0,05
AXA SA FRN 14 - 20.05.49	1 170 000	EUR	1 194 085	1 154 451	0,05
AXA SA FRN 22 - 10.03.43	1 510 000	EUR	1 463 343	1 490 974	0,06
AXA SA FRN 23 - 11.07.43	1 200 000	EUR	1 197 425	1 285 176	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 21 - 11.05.26	2 100 000	EUR	2 014 234	1 951 278	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 21 - 07.03.25	2 000 000	EUR	1 970 993	1 916 260	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.10% 20 - 08.10.27	900 000	EUR	854 027	806 139	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 21 - 19.07.28	1 300 000	EUR	1 194 315	1 125 332	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 21 - 29.06.28	900 000	EUR	828 271	792 711	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 20 - 21.02.31	1 500 000	EUR	1 315 587	1 227 720	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 21 - 03.11.28	1 800 000	EUR	1 656 040	1 574 460	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 22 - 19.11.27	900 000	EUR	829 453	809 820	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 18 - 17.07.25	1 800 000	EUR	1 765 737	1 726 434	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 19 - 08.06.26	2 100 000	EUR	2 052 623	1 976 394	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 20 - 17.01.30	1 200 000	EUR	1 048 856	1 015 704	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.00% 22 - 23.05.25	2 000 000	EUR	1 968 060	1 932 660	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.125% 21 - 19.11.31	900 000	EUR	707 490	727 704	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.125% 22 - 19.01.32	1 300 000	EUR	1 150 734	1 083 537	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 15 - 14.01.25	1 500 000	EUR	1 495 232	1 462 035	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 17 - 26.05.27	1 500 000	EUR	1 468 355	1 406 955	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 20 - 03.06.30	1 200 000	EUR	1 097 152	1 037 484	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.375% 18 - 16.07.28	1 100 000	EUR	1 046 422	1 021 889	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 16 - 19.01.26	1 500 000	EUR	1 479 176	1 450 050	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 17 - 15.11.27	600 000	EUR	558 437	557 346	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19 - 15.03.29	1 300 000	EUR	1 235 465	1 189 448	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 16 - 04.11.26	700 000	EUR	688 763	670 005	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 19 - 18.06.29	1 000 000	EUR	940 659	912 280	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.375% 16 - 24.03.26	1 200 000	EUR	1 189 698	1 173 420	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.50% 18 - 25.05.28	500 000	EUR	478 891	479 695	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 17 - 31.03.27	500 000	EUR	502 572	485 800	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 22 - 06.11.29	1 300 000	EUR	1 255 584	1 235 286	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 15 - 11.09.25	1 200 000	EUR	1 210 743	1 191 096	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.125% 22 - 14.09.27	1 800 000	EUR	1 765 442	1 793 898	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.625% 22 - 14.09.32	1 000 000	EUR	972 454	1 012 880	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.75% 22 - 01.02.33	1 800 000	EUR	1 777 765	1 837 404	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 22 - 16.06.32	1 400 000	EUR	1 369 200	1 382 822	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.875% 23 - 26.01.28	1 200 000	EUR	1 180 876	1 217 700	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.875% 23 - 14.02.28	600 000	EUR	593 465	615 468	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 22 - 21.11.29	800 000	EUR	805 168	828 600	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 23 - 26.01.33	600 000	EUR	593 846	615 810	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.125% 23 - 13.03.29	1 600 000	EUR	1 617 652	1 660 864	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.125% 23 - 14.06.33	1 400 000	EUR	1 390 873	1 468 614	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.125% 23 - 18.09.30	700 000	EUR	696 495	735 056	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.375% 23 - 02.05.30	1 400 000	EUR	1 404 692	1 453 886	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.75% 23 - 10.11.31	1 500 000	EUR	1 526 876	1 592 085	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 5.125% 23 - 13.01.33	1 500 000	EUR	1 515 980	1 605 930	0,07
BNP Paribas Cardif SA FRN 14 - 29.11.49	1 100 000	EUR	1 140 522	1 083 940	0,05
BNP Paribas SA 0.125% 19 - 04.09.26	1 100 000	EUR	1 015 208	1 015 146	0,04
BNP Paribas SA FRN 21 - 13.04.27	1 400 000	EUR	1 326 417	1 299 214	0,05
BNP Paribas SA FRN 20 - 14.10.27	800 000	EUR	759 805	738 008	0,03
BNP Paribas SA FRN 19 - 04.06.26	1 000 000	EUR	971 483	956 400	0,04
BNP Paribas SA FRN 20 - 19.02.28	1 400 000	EUR	1 305 144	1 273 958	0,05
BNP Paribas SA FRN 20 - 01.09.28	1 100 000	EUR	991 438	986 788	0,04
BNP Paribas SA FRN 21 - 19.01.30	1 200 000	EUR	1 043 015	1 029 144	0,04
BNP Paribas SA FRN 21 - 30.05.28	1 200 000	EUR	1 140 946	1 086 552	0,05
BNP Paribas SA 0.625% 20 - 03.12.32	2 000 000	EUR	1 727 542	1 558 040	0,07
BNP Paribas SA FRN 21 - 31.08.33	1 200 000	EUR	1 064 370	1 029 792	0,04
BNP Paribas SA FRN 22 - 11.07.30	1 700 000	EUR	1 586 407	1 465 230	0,06
BNP Paribas SA 1.125% 18 - 11.06.26	1 470 000	EUR	1 422 788	1 399 322	0,06
BNP Paribas SA FRN 20 - 15.01.32	1 100 000	EUR	1 009 212	1 003 057	0,04
BNP Paribas SA FRN 20 - 17.04.29	1 500 000	EUR	1 407 323	1 353 990	0,06
BNP Paribas SA 1.25% 18 - 19.03.25	990 000	EUR	978 270	962 735	0,04
BNP Paribas SA 1.375% 19 - 28.05.29	1 700 000	EUR	1 579 315	1 528 844	0,06
BNP Paribas SA 1.50% 16 - 25.05.28	1 165 000	EUR	1 140 829	1 102 731	0,05
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 17.11.25	1 470 000	EUR	1 442 146	1 424 665	0,06
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 23.05.28	1 040 000	EUR	1 016 711	974 813	0,04
BNP Paribas SA 1.625% 16 - 23.02.26	1 270 000	EUR	1 268 074	1 231 506	0,05
BNP Paribas SA 1.625% 19 - 02.07.31	1 100 000	EUR	962 996	939 400	0,04
BNP Paribas SA 2.10% 22 - 07.04.32	1 800 000	EUR	1 604 595	1 607 724	0,07
BNP Paribas SA FRN 19 - 23.01.27	2 600 000	EUR	2 598 018	2 526 004	0,11
BNP Paribas SA 2.25% 16 - 11.01.27	1 270 000	EUR	1 247 186	1 233 995	0,05
BNP Paribas SA 2.375% 15 - 17.02.25	1 660 000	EUR	1 660 284	1 636 528	0,07
BNP Paribas SA FRN 18 - 20.11.30	500 000	EUR	492 221	485 520	0,02
BNP Paribas SA FRN 22 - 31.03.32	1 900 000	EUR	1 827 770	1 798 255	0,08
BNP Paribas SA 2.75% 15 - 27.01.26	900 000	EUR	898 825	891 963	0,04
BNP Paribas SA FRN 22 - 25.07.28	1 800 000	EUR	1 760 775	1 752 768	0,07
BNP Paribas SA 2.875% 16 - 01.10.26	900 000	EUR	917 171	890 127	0,04
BNP Paribas SA 3.625% 22 - 01.09.29	1 800 000	EUR	1 765 342	1 806 588	0,08
BNP Paribas SA FRN 23 - 10.01.31	1 600 000	EUR	1 601 540	1 647 440	0,07
BNP Paribas SA FRN 23 - 23.02.29	1 100 000	EUR	1 092 400	1 125 025	0,05
BNP Paribas SA 4.125% 23 - 24.05.33	1 500 000	EUR	1 494 028	1 581 450	0,07
BNP Paribas SA FRN 23 - 26.09.32	1 800 000	EUR	1 781 211	1 885 356	0,08
BNP Paribas SA FRN 23 - 13.04.31	1 100 000	EUR	1 094 751	1 137 565	0,05
BNP Paribas SA FRN 23 - 13.01.29	1 200 000	EUR	1 199 113	1 242 384	0,05
BNP Paribas SA FRN 23 - 13.11.32	1 800 000	EUR	1 823 927	1 909 638	0,08
Bouygues SA 0.50% 21 - 11.02.30	1 600 000	EUR	1 395 645	1 388 704	0,06
Bouygues SA 1.125% 20 - 24.07.28	1 500 000	EUR	1 454 639	1 397 760	0,06
Bouygues SA 1.375% 16 - 07.06.27	1 500 000	EUR	1 429 822	1 428 300	0,06
Bouygues SA 2.25% 22 - 29.06.29	1 300 000	EUR	1 256 506	1 256 684	0,05
Bouygues SA 3.25% 22 - 30.06.37	1 300 000	EUR	1 228 142	1 271 894	0,05
Bouygues SA 3.875% 23 - 17.07.31	1 500 000	EUR	1 493 225	1 564 455	0,07
Bouygues SA 4.625% 22 - 07.06.32	1 900 000	EUR	1 952 652	2 087 283	0,09

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Bouygues SA 5.375% 22 - 30.06.42	1 500 000	EUR	1 566 632	1 782 135	0,07
BPCE SA 0.01% 21 - 14.01.27	1 000 000	EUR	931 859	911 490	0,04
BPCE SA 0.25% 20 - 15.01.26	1 700 000	EUR	1 629 081	1 597 830	0,07
BPCE SA 0.25% 21 - 14.01.31	1 500 000	EUR	1 285 407	1 207 650	0,05
BPCE SA 0.375% 22 - 02.02.26	1 200 000	EUR	1 153 173	1 131 168	0,05
BPCE SA 0.50% 19 - 24.02.27	1 300 000	EUR	1 225 932	1 190 280	0,05
BPCE SA FRN 20 - 15.09.27	1 500 000	EUR	1 431 156	1 383 870	0,06
BPCE SA FRN 22 - 14.01.28	700 000	EUR	671 327	638 946	0,03
BPCE SA 0.625% 20 - 15.01.30	800 000	EUR	718 341	685 080	0,03
BPCE SA 0.625% 20 - 28.04.25	1 900 000	EUR	1 869 366	1 829 510	0,08
BPCE SA 0.75% 21 - 03.03.31	1 100 000	EUR	965 613	912 725	0,04
BPCE SA 1.00% 16 - 05.10.28	1 000 000	EUR	981 807	913 850	0,04
BPCE SA 1.00% 19 - 01.04.25	1 200 000	EUR	1 178 942	1 162 668	0,05
BPCE SA 1.00% 22 - 14.01.32	1 300 000	EUR	1 147 188	1 072 019	0,04
BPCE SA 1.375% 18 - 23.03.26	900 000	EUR	884 079	863 532	0,04
BPCE SA 1.625% 18 - 31.01.28	800 000	EUR	751 621	748 296	0,03
BPCE SA FRN 22 - 02.03.29	900 000	EUR	847 838	831 159	0,03
BPCE SA FRN 22 - 02.02.34	1 100 000	EUR	946 676	968 671	0,04
BPCE SA 1.75% 22 - 26.04.27	1 200 000	EUR	1 161 667	1 148 736	0,05
BPCE SA FRN 22 - 02.03.32	500 000	EUR	472 665	468 155	0,02
BPCE SA 2.375% 22 - 26.04.32	700 000	EUR	642 961	650 769	0,03
BPCE SA 2.875% 16 - 22.04.26	1 000 000	EUR	998 606	989 310	0,04
BPCE SA 3.50% 23 - 25.01.28	1 400 000	EUR	1 381 900	1 415 456	0,06
BPCE SA 3.625% 23 - 17.04.26	1 300 000	EUR	1 293 250	1 311 180	0,05
BPCE SA 4.00% 22 - 29.11.32	1 700 000	EUR	1 711 778	1 776 058	0,07
BPCE SA 4.125% 23 - 10.07.28	600 000	EUR	602 932	622 236	0,03
BPCE SA 4.375% 23 - 13.07.28	1 100 000	EUR	1 109 036	1 137 136	0,05
BPCE SA 4.50% 23 - 13.01.33	1 400 000	EUR	1 420 109	1 471 232	0,06
BPCE SA FRN 23 - 02.03.30	1 300 000	EUR	1 297 172	1 358 500	0,06
BPCE SA FRN 23 - 14.06.34	1 000 000	EUR	1 000 269	1 063 400	0,04
BPCE SA FRN 23 - 25.01.35	1 700 000	EUR	1 682 417	1 748 416	0,07
BPCE SA FRN 23 - 01.06.33	600 000	EUR	605 382	634 146	0,03
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 0.75% 21 - 07.07.28	700 000	EUR	620 216	620 914	0,03
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 2.125% 19 - 16.09.29	700 000	EUR	644 239	640 255	0,03
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 3.375% 18 - 24.09.28	500 000	EUR	494 917	495 900	0,02
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 6.00% 17 - 23.01.27	600 000	EUR	647 346	644 616	0,03
Capgemini SE 0.625% 20 - 23.06.25	1 100 000	EUR	1 072 062	1 056 737	0,04
Capgemini SE 1.125% 20 - 23.06.30	1 200 000	EUR	1 109 231	1 071 540	0,04
Capgemini SE 1.625% 20 - 15.04.26	1 300 000	EUR	1 277 317	1 258 894	0,05
Capgemini SE 1.75% 18 - 18.04.28	900 000	EUR	864 392	858 375	0,04
Capgemini SE 2.00% 20 - 15.04.29	1 200 000	EUR	1 226 846	1 148 316	0,05
Capgemini SE 2.375% 20 - 15.04.32	1 800 000	EUR	1 774 689	1 705 068	0,07
Carrefour Banque SA 0.107% 21 - 14.06.25	500 000	EUR	476 183	476 420	0,02
Carrefour Banque SA 4.079% 23 - 05.05.27	600 000	EUR	599 288	609 252	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Carrefour SA 1.00% 19 - 17.05.27	600 000	EUR	574 782	560 484	0,02
Carrefour SA 1.25% 15 - 03.06.25	1 160 000	EUR	1 147 378	1 125 316	0,05
Carrefour SA 1.75% 18 - 04.05.26	600 000	EUR	591 291	581 940	0,02
Carrefour SA 1.875% 22 - 30.10.26	1 200 000	EUR	1 166 816	1 159 992	0,05
Carrefour SA 2.375% 22 - 30.10.29	1 000 000	EUR	946 393	958 370	0,04
Carrefour SA 2.625% 20 - 15.12.27	1 400 000	EUR	1 433 744	1 373 134	0,06
Carrefour SA 3.75% 23 - 10.10.30	700 000	EUR	692 066	714 539	0,03
Carrefour SA 4.125% 22 - 12.10.28	1 300 000	EUR	1 310 328	1 352 650	0,06
Carrefour SA 4.375% 23 - 14.11.31	1 200 000	EUR	1 210 953	1 272 372	0,05
Cie de Saint-Gobain 1.00% 17 - 17.03.25	1 100 000	EUR	1 084 718	1 070 234	0,04
Cie de Saint-Gobain 1.125% 18 - 23.03.26	1 100 000	EUR	1 075 263	1 053 679	0,04
Cie de Saint-Gobain 1.375% 17 - 14.06.27	1 100 000	EUR	1 063 910	1 043 174	0,04
Cie de Saint-Gobain 1.625% 22 - 10.08.25	600 000	EUR	587 933	584 166	0,02
Cie de Saint-Gobain 1.875% 18 - 21.09.28	1 000 000	EUR	1 002 618	951 270	0,04
Cie de Saint-Gobain 1.875% 19 - 15.03.31	1 500 000	EUR	1 437 179	1 384 380	0,06
Cie de Saint-Gobain 2.125% 22 - 10.06.28	700 000	EUR	666 523	672 490	0,03
Cie de Saint-Gobain 2.375% 20 - 04.10.27	1 100 000	EUR	1 107 082	1 078 550	0,05
Cie de Saint-Gobain 2.625% 22 - 10.08.32	700 000	EUR	645 073	671 979	0,03
Cie de Saint-Gobain 3.50% 23 - 18.01.29	900 000	EUR	892 549	919 125	0,04
Cie de Saint-Gobain SA 3.75% 23 - 29.11.26	1 500 000	EUR	1 507 059	1 525 035	0,06
Cie de Saint-Gobain SA 3.875% 23 - 29.11.30	1 600 000	EUR	1 609 549	1 653 392	0,07
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 0.75% 16 - 09.09.28	700 000	EUR	663 486	641 585	0,03
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.00% 20 - 19.05.31	1 400 000	EUR	1 285 430	1 212 400	0,05
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.125% 17 - 13.10.27	1 200 000	EUR	1 159 966	1 129 200	0,05
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA Zero Coupon 20 - 02.11.28	600 000	EUR	534 938	529 218	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.25% 20 - 02.11.32	1 000 000	EUR	860 946	803 320	0,03
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.625% 20 - 02.11.40	600 000	EUR	408 668	406 824	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.875% 18 - 03.09.25	1 100 000	EUR	1 077 842	1 059 575	0,04
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 15 - 28.05.27	300 000	EUR	304 234	289 173	0,01
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 18 - 03.09.30	1 600 000	EUR	1 552 764	1 494 288	0,06
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 2.50% 18 - 03.09.38	1 000 000	EUR	1 041 410	933 640	0,04
Coface SA 5.75% 23 - 28.11.33	300 000	EUR	299 035	311 097	0,01
Coface SA 6.00% 22 - 22.09.32	400 000	EUR	399 575	426 944	0,02
Cofiroute SA 0.375% 16 - 07.02.25	800 000	EUR	783 453	773 160	0,03
Covivio 1.125% 19 - 17.09.31	700 000	EUR	621 633	575 981	0,02
Covivio 1.50% 17 - 21.06.27	600 000	EUR	584 145	563 574	0,02
Covivio 1.625% 20 - 23.06.30	700 000	EUR	628 345	620 543	0,03
Covivio 1.875% 16 - 20.05.26	600 000	EUR	592 585	577 632	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Covivio 2.375% 18 - 20.02.28	310 000	EUR	295 896	296 648	0,01
Covivio SA 4.625% 23 - 05.06.32	600 000	EUR	601 309	621 702	0,03
Credit Agricole Assurances SA 1.50% 21 - 06.10.31	1 100 000	EUR	906 084	897 292	0,04
Credit Agricole Assurances SA 2.00% 20 - 17.07.30	1 200 000	EUR	1 074 150	1 052 940	0,04
Credit Agricole Assurances SA FRN 18 - 29.01.48	1 100 000	EUR	1 065 457	1 022 527	0,04
Credit Agricole Assurances SA FRN 15 - 31.12.99	600 000	EUR	608 931	596 598	0,03
Credit Agricole Assurances SA FRN 14 - 31.10.49	800 000	EUR	813 885	796 296	0,03
Credit Agricole Assurances SA FRN 16 - 27.09.48	1 200 000	EUR	1 222 245	1 209 216	0,05
Credit Agricole Assurances SA 5.875% 23 - 25.10.33	600 000	EUR	606 751	659 214	0,03
Credit Agricole SA 0.125% 20 - 09.12.27	1 200 000	EUR	1 107 930	1 064 664	0,04
Credit Agricole SA 0.375% 19 - 21.10.25	1 100 000	EUR	1 069 584	1 048 311	0,04
Credit Agricole SA 0.375% 21 - 20.04.28	1 100 000	EUR	1 008 326	971 817	0,04
Credit Agricole SA FRN 21 - 21.09.29	1 200 000	EUR	1 114 317	1 046 964	0,04
Credit Agricole SA FRN 22 - 12.01.28	800 000	EUR	741 198	735 672	0,03
Credit Agricole SA 0.875% 20 - 14.01.32	1 500 000	EUR	1 315 625	1 233 720	0,05
Credit Agricole SA 1.00% 19 - 03.07.29	1 200 000	EUR	1 147 540	1 069 452	0,04
Credit Agricole SA FRN 20 - 22.04.26	1 700 000	EUR	1 665 785	1 640 330	0,07
Credit Agricole SA 1.00% 22 - 18.09.25	1 400 000	EUR	1 370 654	1 352 036	0,06
Credit Agricole SA 1.125% 22 - 12.07.32	1 200 000	EUR	1 032 101	1 005 804	0,04
Credit Agricole SA 1.125% 22 - 24.02.29	1 200 000	EUR	1 141 123	1 093 020	0,05
Credit Agricole SA 1.25% 16 - 14.04.26	1 800 000	EUR	1 780 281	1 724 886	0,07
Credit Agricole SA 1.375% 17 - 03.05.27	1 800 000	EUR	1 765 421	1 705 716	0,07
Credit Agricole SA 1.375% 18 - 13.03.25	1 100 000	EUR	1 088 030	1 072 731	0,04
Credit Agricole SA FRN 20 - 05.06.30	900 000	EUR	861 919	869 616	0,04
Credit Agricole SA 1.75% 19 - 05.03.29	1 700 000	EUR	1 658 921	1 570 069	0,07
Credit Agricole SA 1.875% 16 - 20.12.26	1 800 000	EUR	1 776 058	1 732 878	0,07
Credit Agricole SA FRN 22 - 22.04.27	800 000	EUR	772 140	771 504	0,03
Credit Agricole SA 2.00% 19 - 25.03.29	1 500 000	EUR	1 443 792	1 390 785	0,06
Credit Agricole SA 2.50% 22 - 22.04.34	900 000	EUR	786 240	827 316	0,03
Credit Agricole SA 2.50% 22 - 29.08.29	1 500 000	EUR	1 436 443	1 446 075	0,06
Credit Agricole SA 2.625% 15 - 17.03.27	2 190 000	EUR	2 183 845	2 124 322	0,09
Credit Agricole SA 3.125% 14 - 05.02.26	1 200 000	EUR	1 247 142	1 202 472	0,05
Credit Agricole SA 3.375% 22 - 28.07.27	1 200 000	EUR	1 196 472	1 208 400	0,05
Credit Agricole SA 3.875% 22 - 28.11.34	1 700 000	EUR	1 689 707	1 780 002	0,07
Credit Agricole SA 3.875% 23 - 20.04.31	1 700 000	EUR	1 688 819	1 756 950	0,07
Credit Agricole SA FRN 22 - 12.10.26	1 200 000	EUR	1 197 953	1 209 816	0,05
Credit Agricole SA 4.00% 23 - 18.01.33	1 200 000	EUR	1 211 960	1 262 064	0,05
Credit Agricole SA 4.125% 23 - 07.03.30	1 200 000	EUR	1 229 170	1 253 364	0,05
Credit Agricole SA FRN 23 - 11.07.29	1 200 000	EUR	1 193 146	1 238 064	0,05
Credit Agricole SA 4.375% 23 - 27.11.33	1 400 000	EUR	1 414 303	1 470 196	0,06
Credit Agricole SA FRN 23 - 28.08.33	1 100 000	EUR	1 102 831	1 155 000	0,05
Credit Mutuel Arkea SA 0.01% 20 - 28.01.26	700 000	EUR	683 938	655 655	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 0.375% 19 - 03.10.28	600 000	EUR	545 978	525 090	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.75% 22 - 18.01.30	700 000	EUR	610 755	601 594	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 20 - 07.05.27	900 000	EUR	859 456	832 509	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 21 - 11.03.33	900 000	EUR	720 399	715 140	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 21 - 25.10.31	600 000	EUR	518 515	492 972	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 1.125% 19 - 23.05.29	600 000	EUR	563 545	537 144	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 - 11.06.29	1 000 000	EUR	927 298	907 800	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 1.375% 19 - 17.01.25	500 000	EUR	494 468	488 480	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 1.625% 19 - 15.04.26	600 000	EUR	589 189	577 056	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 3.25% 16 - 01.06.26	500 000	EUR	500 872	500 980	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 19 - 11.03.31	800 000	EUR	807 084	770 528	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 22 - 19.09.27	1 100 000	EUR	1 078 336	1 104 521	0,05
Credit Mutuel Arkea SA 3.50% 17 - 09.02.29	500 000	EUR	500 769	494 065	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 3.875% 23 - 22.05.28	700 000	EUR	698 301	715 393	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 4.125% 23 - 02.04.31	700 000	EUR	693 106	733 474	0,03
Credit Mutuel Arkea SA 4.125% 23 - 01.02.34	1 000 000	EUR	1 007 831	1 051 260	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 4.25% 22 - 01.12.32	400 000	EUR	401 868	420 408	0,02
Dassault Systemes SE 0.125% 19 - 16.09.26	1 300 000	EUR	1 240 083	1 211 561	0,05
Dassault Systemes SE 0.375% 19 - 16.09.29	1 600 000	EUR	1 457 942	1 409 584	0,06
Edenred 1.375% 15 - 10.03.25	700 000	EUR	686 749	682 640	0,03
Edenred 1.375% 20 - 18.06.29	600 000	EUR	567 273	551 808	0,02
Edenred 1.875% 17 - 30.03.27	700 000	EUR	691 204	675 262	0,03
Edenred 1.875% 18 - 06.03.26	600 000	EUR	587 006	584 292	0,02
Edenred 3.625% 23 - 13.12.26	800 000	EUR	796 530	811 008	0,03
Edenred 3.625% 23 - 13.06.31	1 300 000	EUR	1 286 953	1 322 542	0,06
Elis SA 1.00% 19 - 03.04.25	600 000	EUR	574 905	577 482	0,02
ELO SACA 2.375% 19 - 25.04.25	1 000 000	EUR	985 213	976 330	0,04
ELO SACA 2.875% 20 - 29.01.26	1 200 000	EUR	1 189 738	1 167 024	0,05
ELO SACA 3.25% 20 - 23.07.27	900 000	EUR	873 435	873 504	0,04
ELO SACA 4.875% 22 - 08.12.28	1 000 000	EUR	966 801	990 140	0,04
ELO SACA 6.00% 23 - 22.03.29	1 200 000	EUR	1 194 995	1 219 272	0,05
EssilorLuxottica SA 0.125% 19 - 27.05.25	2 200 000	EUR	2 152 925	2 102 870	0,09
EssilorLuxottica SA 0.375% 19 - 27.11.27	2 400 000	EUR	2 276 630	2 195 184	0,09
EssilorLuxottica SA 0.375% 20 - 05.01.26	1 800 000	EUR	1 762 054	1 709 136	0,07
EssilorLuxottica SA 0.50% 20 - 05.06.28	1 800 000	EUR	1 701 183	1 641 996	0,07
EssilorLuxottica SA 0.75% 19 - 27.11.31	1 400 000	EUR	1 327 581	1 207 430	0,05
Firmenich Productions Participations SAS 1.375% 20 - 30.10.26	900 000	EUR	844 284	863 559	0,04
Firmenich Productions Participations SAS 1.75% 20 - 30.04.30	1 350 000	EUR	1 213 389	1 250 221	0,05
Gecina SA 0.875% 21 - 30.06.36	800 000	EUR	635 200	591 336	0,02
Gecina SA 0.875% 22 - 25.01.33	700 000	EUR	574 041	577 976	0,02
Gecina SA 1.00% 16 - 30.01.29	400 000	EUR	375 792	364 128	0,02
Gecina SA 1.375% 17 - 30.06.27	800 000	EUR	766 047	761 760	0,03
Gecina SA 1.375% 17 - 26.01.28	1 100 000	EUR	1 041 919	1 031 162	0,04
Gecina SA 1.50% 15 - 20.01.25	500 000	EUR	495 284	490 260	0,02
Gecina SA 1.625% 18 - 14.03.30	500 000	EUR	488 623	463 165	0,02
Gecina SA 1.625% 19 - 29.05.34	900 000	EUR	821 951	782 046	0,03
Gecina SA 2.00% 17 - 30.06.32	800 000	EUR	778 805	737 920	0,03
Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR FRN 21 - 21.04.42	900 000	EUR	772 626	726 318	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 0.625% 21 - 14.09.28	900 000	EUR	786 446	794 907	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.475% 22 - 18.01.31	1 500 000	EUR	1 287 771	1 285 845	0,05
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.625% 17 - 27.11.27	700 000	EUR	651 149	656 194	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.625% 20 - 18.09.29	900 000	EUR	806 109	809 172	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 2.25% 14 - 24.03.25	800 000	EUR	792 973	784 240	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 2.50% 20 - 04.05.27	1 000 000	EUR	968 495	970 690	0,04
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 4.25% 23 - 18.03.30	700 000	EUR	686 519	719 600	0,03
HSBC Continental Europe SA 0.10% 19 - 03.09.27	1 500 000	EUR	1 421 981	1 345 920	0,06
HSBC Continental Europe SA 1.375% 18 - 04.09.28	900 000	EUR	873 575	829 737	0,03
ICADE 0.625% 21 - 18.01.31	600 000	EUR	491 768	472 920	0,02
ICADE 1.00% 22 - 19.01.30	600 000	EUR	503 554	510 366	0,02
ICADE 1.125% 16 - 17.11.25	600 000	EUR	580 862	571 164	0,02
ICADE 1.50% 17 - 13.09.27	700 000	EUR	670 907	651 224	0,03
ICADE 1.625% 18 - 28.02.28	900 000	EUR	856 451	836 883	0,04
ICADE 1.75% 16 - 10.06.26	900 000	EUR	885 688	859 140	0,04
Imerys SA 1.00% 21 - 15.07.31	400 000	EUR	307 656	314 972	0,01
Imerys SA 1.50% 17 - 15.01.27	800 000	EUR	751 024	749 984	0,03
Imerys SA 1.875% 16 - 31.03.28	400 000	EUR	379 648	369 868	0,02
Imerys SA 4.75% 23 - 29.11.29	900 000	EUR	896 880	915 264	0,04
JCDecaux SE 1.625% 22 - 07.02.30	800 000	EUR	682 707	697 216	0,03
JCDecaux SE 2.625% 20 - 24.04.28	700 000	EUR	682 466	685 671	0,03
JCDecaux SE 5.00% 23 - 11.01.29	900 000	EUR	912 804	946 107	0,04
Kering SA 0.75% 20 - 13.05.28	800 000	EUR	760 645	733 160	0,03
Kering SA 1.25% 16 - 10.05.26	700 000	EUR	682 027	672 777	0,03
Kering SA 1.25% 22 - 05.05.25	1 100 000	EUR	1 077 732	1 068 969	0,04
Kering SA 1.50% 17 - 05.04.27	400 000	EUR	401 038	382 960	0,02
Kering SA 1.875% 22 - 05.05.30	900 000	EUR	855 668	848 844	0,04
Kering SA 3.25% 23 - 27.02.29	1 200 000	EUR	1 186 575	1 220 484	0,05
Kering SA 3.375% 23 - 27.02.33	1 100 000	EUR	1 078 563	1 120 537	0,05
Kering SA 3.625% 23 - 05.09.27	1 000 000	EUR	998 165	1 022 680	0,04
Kering SA 3.625% 23 - 05.09.31	1 600 000	EUR	1 596 189	1 654 624	0,07
Kering SA 3.75% 23 - 05.09.25	1 100 000	EUR	1 099 540	1 108 382	0,05
Kering SA 3.875% 23 - 05.09.35	2 000 000	EUR	1 991 997	2 096 740	0,09
Klepierre SA 0.625% 19 - 01.07.30	700 000	EUR	586 463	583 352	0,02
Klepierre SA 0.875% 20 - 17.02.31	600 000	EUR	516 855	499 104	0,02
Klepierre SA 1.25% 16 - 29.09.31	800 000	EUR	719 223	676 208	0,03
Klepierre SA 1.375% 17 - 16.02.27	700 000	EUR	685 985	663 376	0,03
Klepierre SA 1.625% 17 - 13.12.32	1 000 000	EUR	906 096	855 610	0,04
Klepierre SA 1.875% 16 - 19.02.26	400 000	EUR	393 768	389 188	0,02
Klepierre SA 2.00% 20 - 12.05.29	900 000	EUR	854 939	844 353	0,04
Legrand SA 0.375% 21 - 06.10.31	1 000 000	EUR	873 291	835 690	0,04
Legrand SA 0.625% 19 - 24.06.28	500 000	EUR	460 328	456 980	0,02
Legrand SA 0.75% 20 - 20.05.30	900 000	EUR	798 465	788 751	0,03

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.00% 18 - 06.03.26	500 000	EUR	486 064	481 135	0,02
Legrand SA 1.875% 15 - 16.12.27	300 000	EUR	305 419	287 904	0,01
Legrand SA 1.875% 17 - 06.07.32	700 000	EUR	710 709	654 724	0,03
Legrand SA 3.50% 23 - 29.05.29	1 100 000	EUR	1 107 873	1 136 564	0,05
L'Oreal SA 0.875% 22 - 29.06.26	1 900 000	EUR	1 845 357	1 811 574	0,08
L'Oreal SA 2.875% 23 - 19.05.28	1 500 000	EUR	1 486 711	1 507 590	0,06
L'Oreal SA 3.125% 23 - 19.05.25	1 400 000	EUR	1 395 172	1 397 858	0,06
L'Oreal SA 3.375% 23 - 23.01.27	1 200 000	EUR	1 203 840	1 219 632	0,05
L'Oreal SA 3.375% 23 - 23.11.29	1 000 000	EUR	1 008 184	1 030 960	0,04
Mercialys SA 1.80% 18 - 27.02.26	300 000	EUR	281 310	286 677	0,01
Mercialys SA 2.50% 22 - 28.02.29	600 000	EUR	533 485	547 686	0,02
Nerval SAS 2.875% 22 - 14.04.32	600 000	EUR	546 560	540 174	0,02
Nerval SAS 3.625% 22 - 20.07.28	300 000	EUR	289 863	298 185	0,01
New Immo Holdings SA 2.75% 19 - 26.11.26	300 000	EUR	277 778	275 940	0,01
Orange SA Zero Coupon 19 - 04.09.26	1 200 000	EUR	1 140 648	1 112 412	0,05
Orange SA Zero Coupon 21 - 29.06.26	1 000 000	EUR	928 394	931 150	0,04
Orange SA 0.125% 20 - 16.09.29	800 000	EUR	711 209	690 768	0,03
Orange SA 0.50% 19 - 04.09.32	1 400 000	EUR	1 265 886	1 142 260	0,05
Orange SA 0.625% 21 - 16.12.33	1 600 000	EUR	1 318 610	1 280 336	0,05
Orange SA 0.75% 21 - 29.06.34	1 100 000	EUR	897 970	875 875	0,04
Orange SA 0.875% 16 - 03.02.27	1 100 000	EUR	1 078 160	1 036 354	0,04
Orange SA 1.00% 16 - 12.05.25	1 100 000	EUR	1 096 464	1 065 053	0,04
Orange SA 1.00% 18 - 12.09.25	1 100 000	EUR	1 084 901	1 060 290	0,04
Orange SA 1.20% 19 - 11.07.34	500 000	EUR	423 438	415 780	0,02
Orange SA 1.25% 20 - 07.07.27	1 100 000	EUR	1 066 577	1 042 217	0,04
Orange SA 1.375% 18 - 16.01.30	1 400 000	EUR	1 376 567	1 286 740	0,05
Orange SA 1.375% 18 - 20.03.28	1 500 000	EUR	1 438 950	1 414 140	0,06
Orange SA 1.375% 19 - 04.09.49	1 100 000	EUR	967 696	798 567	0,03
Orange SA FRN 21 - 31.12.99	600 000	EUR	508 088	511 530	0,02
Orange SA 1.50% 17 - 09.09.27	700 000	EUR	703 650	671 384	0,03
Orange SA 1.625% 20 - 07.04.32	1 200 000	EUR	1 132 330	1 085 856	0,05
Orange SA FRN 19 - 31.12.99	600 000	EUR	578 319	557 850	0,02
Orange SA FRN 20 - 31.12.99	900 000	EUR	798 090	798 093	0,03
Orange SA 1.875% 18 - 12.09.30	1 800 000	EUR	1 758 697	1 689 552	0,07
Orange SA 2.00% 19 - 15.01.29	1 900 000	EUR	1 862 362	1 825 406	0,08
Orange SA FRN 19 - 31.12.99	1 400 000	EUR	1 382 302	1 361 304	0,06
Orange SA 2.375% 22 - 18.05.32	800 000	EUR	751 075	766 968	0,03
Orange SA 3.625% 22 - 16.11.31	1 200 000	EUR	1 207 654	1 252 164	0,05
Orange SA 3.875% 23 - 11.09.35	700 000	EUR	681 867	744 821	0,03
Orange SA FRN 14 - 29.10.49	1 730 000	EUR	1 851 884	1 765 846	0,07
Orange SA FRN 23 - 31.12.99	1 500 000	EUR	1 495 064	1 571 055	0,07
Orange SA 8.125% 03 - 28.01.33	2 253 000	EUR	3 249 850	3 158 931	0,13
RCI Banque SA 0.50% 22 - 14.07.25	1 124 000	EUR	1 063 410	1 073 802	0,05
RCI Banque SA 1.125% 20 - 15.01.27	930 000	EUR	848 937	870 331	0,04
RCI Banque SA 1.625% 17 - 11.04.25	800 000	EUR	775 261	780 856	0,03
RCI Banque SA 1.625% 18 - 26.05.26	1 130 000	EUR	1 063 167	1 080 856	0,05
RCI Banque SA 1.75% 19 - 10.04.26	923 000	EUR	872 724	886 505	0,04
RCI Banque SA 4.125% 22 - 01.12.25	1 285 000	EUR	1 281 387	1 294 278	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
RCI Banque SA 4.50% 23 - 06.04.27	1 130 000	EUR	1 127 826	1 160 838	0,05
RCI Banque SA 4.625% 23 - 13.07.26	1 030 000	EUR	1 034 552	1 052 928	0,04
RCI Banque SA 4.625% 23 - 02.10.26	1 150 000	EUR	1 154 425	1 179 923	0,05
RCI Banque SA 4.75% 22 - 06.07.27	720 000	EUR	726 372	751 450	0,03
RCI Banque SA 4.875% 22 - 21.09.28	1 060 000	EUR	1 072 196	1 121 512	0,05
RCI Banque SA 4.875% 23 - 14.06.28	930 000	EUR	938 281	978 686	0,04
RCI Banque SA 4.875% 23 - 02.10.29	1 200 000	EUR	1 192 659	1 261 932	0,05
SANEF SA 0.95% 16 - 19.10.28	300 000	EUR	268 889	270 636	0,01
SANEF SA 1.875% 15 - 16.03.26	1 000 000	EUR	971 032	968 550	0,04
Sanofi 0.50% 16 - 13.01.27	1 600 000	EUR	1 564 469	1 501 424	0,06
Sanofi 0.875% 19 - 21.03.29	1 000 000	EUR	934 640	914 260	0,04
Sanofi 0.875% 22 - 06.04.25	1 300 000	EUR	1 273 203	1 261 364	0,05
Sanofi 1.00% 18 - 21.03.26	2 100 000	EUR	2 079 552	2 017 575	0,08
Sanofi 1.00% 20 - 01.04.25	1 500 000	EUR	1 476 454	1 457 070	0,06
Sanofi 1.125% 16 - 05.04.28	900 000	EUR	872 934	845 469	0,04
Sanofi 1.25% 19 - 21.03.34	600 000	EUR	555 423	521 850	0,02
Sanofi 1.25% 22 - 06.04.29	1 100 000	EUR	1 011 192	1 023 748	0,04
Sanofi 1.375% 18 - 21.03.30	2 900 000	EUR	2 803 285	2 678 150	0,11
Sanofi 1.50% 15 - 22.09.25	1 200 000	EUR	1 202 243	1 169 328	0,05
Sanofi 1.50% 20 - 01.04.30	1 500 000	EUR	1 481 706	1 394 235	0,06
Sanofi 1.75% 14 - 10.09.26	2 200 000	EUR	2 223 946	2 141 436	0,09
Sanofi 1.875% 18 - 21.03.38	1 800 000	EUR	1 789 316	1 587 168	0,07
Schneider Electric SE 0.25% 20 - 11.03.29	1 100 000	EUR	1 001 472	970 079	0,04
Schneider Electric SE 0.875% 15 - 11.03.25	1 100 000	EUR	1 085 542	1 071 455	0,04
Schneider Electric SE 0.875% 17 - 13.12.26	1 000 000	EUR	995 092	951 700	0,04
Schneider Electric SE 1.00% 20 - 09.04.27	700 000	EUR	668 446	662 963	0,03
Schneider Electric SE 1.375% 18 - 21.06.27	1 100 000	EUR	1 113 165	1 049 158	0,04
Schneider Electric SE 1.50% 19 - 15.01.28	1 000 000	EUR	968 617	953 030	0,04
Schneider Electric SE 3.125% 23 - 13.10.29	1 000 000	EUR	983 866	1 018 370	0,04
Schneider Electric SE 3.25% 22 - 09.11.27	700 000	EUR	700 533	710 780	0,03
Schneider Electric SE 3.25% 23 - 12.06.28	700 000	EUR	692 938	714 665	0,03
Schneider Electric SE 3.375% 23 - 13.04.34	900 000	EUR	897 097	926 379	0,04
Schneider Electric SE 3.375% 23 - 06.04.25	1 200 000	EUR	1 199 925	1 200 852	0,05
Schneider Electric SE 3.50% 22 - 09.11.32	800 000	EUR	804 017	834 576	0,04
Schneider Electric SE 3.50% 23 - 12.06.33	800 000	EUR	793 769	831 144	0,03
SCOR SE FRN 20 - 17.09.51	300 000	EUR	241 075	237 345	0,01
SCOR SE FRN 15 - 08.06.46	900 000	EUR	897 756	874 485	0,04
SCOR SE FRN 16 - 27.05.48	500 000	EUR	520 433	492 255	0,02
Societe Fonciere Lyonnaise SA 0.50% 21 - 21.04.28	600 000	EUR	544 696	538 284	0,02
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 18 - 29.05.25	800 000	EUR	784 090	778 248	0,03
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 20 - 05.06.27	700 000	EUR	678 510	670 432	0,03
Societe Generale SA 0.125% 20 - 24.02.26	1 400 000	EUR	1 527 352	1 311 240	0,05
Societe Generale SA 0.125% 21 - 18.02.28	1 200 000	EUR	1 114 270	1 059 888	0,04
Societe Generale SA FRN 21 - 17.11.26	1 200 000	EUR	1 144 537	1 126 476	0,05
Societe Generale SA 0.25% 21 - 08.07.27	1 300 000	EUR	1 222 887	1 170 364	0,05
Societe Generale SA FRN 21 - 12.06.29	1 200 000	EUR	1 064 268	1 040 652	0,04
Societe Generale SA FRN 21 - 02.12.27	1 200 000	EUR	1 110 841	1 100 100	0,05
Societe Generale SA 0.75% 20 - 25.01.27	1 800 000	EUR	1 681 662	1 655 532	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.875% 19 - 01.07.26	900 000	EUR	872 085	845 658	0,04
Societe Generale SA 0.875% 19 - 24.09.29	900 000	EUR	783 543	769 869	0,03
Societe Generale SA FRN 20 - 22.09.28	1 100 000	EUR	1 046 027	998 338	0,04
Societe Generale SA FRN 20 - 24.11.30	1 200 000	EUR	1 111 994	1 125 552	0,05
Societe Generale SA 1.125% 18 - 23.01.25	1 500 000	EUR	1 487 987	1 457 790	0,06
Societe Generale SA FRN 20 - 21.04.26	1 000 000	EUR	975 602	965 210	0,04
Societe Generale SA FRN 21 - 30.06.31	1 200 000	EUR	1 099 490	1 103 292	0,05
Societe Generale SA 1.25% 20 - 12.06.30	1 200 000	EUR	1 054 361	1 032 048	0,04
Societe Generale SA 1.375% 17 - 13.01.28	800 000	EUR	744 934	741 984	0,03
Societe Generale SA 1.75% 19 - 22.03.29	1 400 000	EUR	1 347 076	1 272 278	0,05
Societe Generale SA 2.125% 18 - 27.09.28	1 400 000	EUR	1 386 509	1 322 636	0,06
Societe Generale SA 2.625% 15 - 27.02.25	1 500 000	EUR	1 497 422	1 477 965	0,06
Societe Generale SA 2.625% 22 - 30.05.29	1 100 000	EUR	1 072 597	1 069 695	0,04
Societe Generale SA 4.00% 22 - 16.11.27	1 100 000	EUR	1 102 793	1 126 202	0,05
Societe Generale SA 4.125% 23 - 02.06.27	1 400 000	EUR	1 390 474	1 436 176	0,06
Societe Generale SA 4.125% 23 - 21.11.28	1 100 000	EUR	1 105 140	1 139 281	0,05
Societe Generale SA 4.25% 22 - 16.11.32	1 400 000	EUR	1 425 060	1 488 578	0,06
Societe Generale SA FRN 22 - 06.12.30	1 700 000	EUR	1 655 961	1 727 965	0,07
Societe Generale SA 4.25% 23 - 28.09.26	1 800 000	EUR	1 800 574	1 845 126	0,08
Societe Generale SA FRN 23 - 28.09.29	1 200 000	EUR	1 192 922	1 250 496	0,05
Societe Generale SA FRN 23 - 21.11.31	1 500 000	EUR	1 518 837	1 568 730	0,07
Societe Generale SA FRN 22 - 06.09.32	500 000	EUR	498 075	518 955	0,02
Societe Generale SA 5.625% 23 - 02.06.33	1 200 000	EUR	1 191 834	1 279 428	0,05
Sodexo SA 0.75% 16 - 14.04.27	960 000	EUR	925 247	910 474	0,04
Sodexo SA 0.75% 20 - 27.04.25	1 190 000	EUR	1 167 782	1 149 861	0,05
Sodexo SA 1.00% 20 - 27.04.29	1 120 000	EUR	1 074 413	1 017 408	0,04
Sodexo SA 1.00% 20 - 27.04.29	200 000	EUR	175 917	181 680	0,01
Sodexo SA 1.00% 20 - 17.07.28	750 000	EUR	696 015	689 415	0,03
Sodexo SA 2.50% 14 - 24.06.26	585 000	EUR	594 329	575 944	0,02
Sogecap SA FRN 14 - 29.12.49	900 000	EUR	901 696	886 986	0,04
Sogecap SA FRN 23 - 16.05.44	900 000	EUR	919 537	971 541	0,04
Teleperformance 0.25% 20 - 26.11.27	700 000	EUR	611 428	624 757	0,03
Teleperformance 1.875% 18 - 02.07.25	900 000	EUR	887 920	872 118	0,04
Teleperformance 3.75% 22 - 24.06.29	600 000	EUR	593 959	597 942	0,03
Teleperformance SE 5.25% 23 - 22.11.28	1 100 000	EUR	1 113 168	1 151 733	0,05
Teleperformance SE 5.75% 23 - 22.11.31	1 100 000	EUR	1 114 379	1 168 607	0,05
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.625% 20 - 04.05.27	1 100 000	EUR	1 025 256	1 005 917	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.75% 21 - 25.10.28	700 000	EUR	655 637	627 767	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.875% 16 - 21.02.25	570 000	EUR	561 211	551 743	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.875% 19 - 29.03.32	900 000	EUR	749 565	719 631	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 15 - 14.03.25	732 000	EUR	713 034	708 642	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 19 - 27.02.27	900 000	EUR	864 146	840 303	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.125% 16 - 28.04.27	520 000	EUR	499 236	491 488	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.125% 18 - 15.09.25	1 100 000	EUR	1 069 111	1 059 971	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 15 - 15.04.30	760 000	EUR	702 054	669 461	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 16 - 09.03.26	570 000	EUR	549 987	546 869	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 20 - 04.12.31	1 200 000	EUR	1 008 920	1 014 816	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 21 - 25.05.33	700 000	EUR	623 116	575 680	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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-Westfield SE 1.50% 17 - 22.02.28	600 000	EUR	577 633	561 618	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.50% 17 - 29.05.29	600 000	EUR	539 247	544 956	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.75% 19 - 27.02.34	900 000	EUR	795 529	765 207	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.75% 19 - 01.07.49	600 000	EUR	401 964	390 780	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.875% 18 - 15.01.31	1 000 000	EUR	887 262	898 080	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.00% 16 - 28.04.36	750 000	EUR	620 796	625 500	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.00% 17 - 29.05.37	500 000	EUR	434 510	409 480	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.00% 20 - 29.06.32	900 000	EUR	813 649	797 229	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.125% 20 - 09.04.25	700 000	EUR	697 944	686 420	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.25% 18 - 14.05.38	600 000	EUR	510 175	492 528	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.50% 14 - 04.06.26	640 000	EUR	634 859	630 368	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.625% 20 - 09.04.30	800 000	EUR	765 405	775 528	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN 18 - 31.12.99	800 000	EUR	731 002	702 488	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 4.125% 23 - 11.12.30	900 000	EUR	934 254	928 683	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN 23 - 31.12.99	1 200 000	EUR	1 086 379	1 198 296	0,05
Verallia SA 1.625% 21 - 14.05.28	600 000	EUR	539 586	560 034	0,02
Verallia SA 1.875% 21 - 10.11.31	800 000	EUR	657 025	702 088	0,03
Vinci SA Zero Coupon 20 - 27.11.28	700 000	EUR	654 097	614 488	0,03
Vinci SA 0.50% 21 - 09.01.32	1 100 000	EUR	926 961	907 236	0,04
Vinci SA 1.00% 18 - 26.09.25	1 300 000	EUR	1 282 470	1 257 724	0,05
Vinci SA 1.625% 19 - 18.01.29	1 500 000	EUR	1 466 352	1 414 785	0,06
Vinci SA 1.75% 18 - 26.09.30	1 500 000	EUR	1 469 969	1 394 070	0,06
Vinci SA 3.375% 22 - 17.10.32	1 200 000	EUR	1 178 505	1 221 576	0,05
Vinci SA 3.375% 23 - 04.02.25	700 000	EUR	695 718	700 007	0,03
Vivendi SE 0.625% 19 - 11.06.25	1 100 000	EUR	1 077 929	1 058 013	0,04
Vivendi SE 1.125% 19 - 11.12.28	1 000 000	EUR	926 457	948 020	0,04
Vivendi SE 1.875% 16 - 26.05.26	600 000	EUR	598 591	586 830	0,02
Wendel SE 1.00% 21 - 01.06.31	300 000	EUR	250 365	251 430	0,01
Wendel SE 1.375% 22 - 18.01.34	400 000	EUR	315 426	318 272	0,01
Wendel SE 2.50% 15 - 09.02.27	800 000	EUR	790 013	774 272	0,03
Wendel SE 4.50% 23 - 19.06.30	600 000	EUR	595 420	619 746	0,03
Worldline SA 0.875% 20 - 30.06.27	600 000	EUR	589 036	541 764	0,02
Worldline SA 4.125% 23 - 12.09.28	900 000	EUR	888 089	890 370	0,04
WPP Finance SA 2.25% 14 - 22.09.26	1 036 000	EUR	1 041 771	1 014 544	0,04
WPP Finance SA 2.375% 20 - 19.05.27	1 070 000	EUR	1 057 680	1 049 189	0,04
WPP Finance SA 4.125% 23 - 30.05.28	1 140 000	EUR	1 144 485	1 175 899	0,05
			559 390 175	554 123 034	23,14
Allemagne					
Aareal Bank AG 0.05% 21 - 02.09.26	700 000	EUR	638 463	625 317	0,03
Aareal Bank AG 0.25% 20 - 23.11.27	900 000	EUR	806 583	768 807	0,03
Aareal Bank AG 0.50% 20 - 07.04.27	500 000	EUR	453 019	442 460	0,02
Aareal Bank AG 0.75% 22 - 18.04.28	500 000	EUR	437 965	431 375	0,02
Aareal Bank AG 4.50% 22 - 25.07.25	500 000	EUR	503 926	501 135	0,02
adidas AG Zero Coupon 20 - 05.10.28	800 000	EUR	711 657	706 136	0,03
adidas AG 0.625% 20 - 10.09.35	600 000	EUR	488 256	462 498	0,02
adidas AG 3.00% 22 - 21.11.25	800 000	EUR	795 309	800 872	0,03
adidas AG 3.125% 22 - 21.11.29	600 000	EUR	596 481	610 632	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Albemarle New Holdings GmbH 1.125% 19 - 25.11.25	510 000	EUR	490 608	488 539	0,02
Albemarle New Holdings GmbH 1.625% 19 - 25.11.28	700 000	EUR	657 761	639 184	0,03
Allianz SE FRN 19 - 25.09.49	1 100 000	EUR	938 077	949 135	0,04
Allianz SE FRN 19 - 25.09.49	100 000	EUR	85 648	86 285	0,00
Allianz SE FRN 20 - 08.07.50	1 200 000	EUR	1 122 537	1 057 416	0,04
Allianz SE FRN 15 - 07.07.45	1 900 000	EUR	1 870 092	1 843 741	0,08
Allianz SE FRN 17 - 06.07.47	1 200 000	EUR	1 195 126	1 175 196	0,05
Allianz SE FRN 22 - 05.07.52	1 500 000	EUR	1 481 271	1 486 035	0,06
Allianz SE FRN 22 - 07.09.38	1 600 000	EUR	1 569 161	1 639 376	0,07
Allianz SE FRN 23 - 25.07.53	1 400 000	EUR	1 427 585	1 532 566	0,06
alstria office REIT-AG 0.50% 19 - 26.09.25	600 000	EUR	555 442	517 932	0,02
alstria office REIT-AG 1.50% 17 - 15.11.27	300 000	EUR	255 494	224 166	0,01
alstria office REIT-AG 1.50% 20 - 23.06.26	400 000	EUR	337 359	326 676	0,01
Amphenol Technologies Holdings GmbH 0.75% 20 - 04.05.26	710 000	EUR	687 826	673 300	0,03
Amphenol Technologies Holdings GmbH 2.00% 18 - 08.10.28	690 000	EUR	668 850	665 291	0,03
Berlin Hyp AG 0.375% 21 - 21.04.31	600 000	EUR	493 925	473 478	0,02
Berlin Hyp AG 0.375% 22 - 25.01.27	700 000	EUR	657 530	645 106	0,03
Berlin Hyp AG 0.50% 19 - 05.11.29	500 000	EUR	442 394	425 180	0,02
Berlin Hyp AG 1.00% 19 - 05.02.26	500 000	EUR	490 336	474 185	0,02
Berlin Hyp AG 1.125% 17 - 25.10.27	700 000	EUR	671 640	640 801	0,03
Berlin Hyp AG 1.25% 15 - 22.01.25	1 000 000	EUR	990 799	967 970	0,04
Berlin Hyp AG 1.50% 18 - 18.04.28	400 000	EUR	378 569	366 188	0,02
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.125% 16 - 27.04.26	700 000	EUR	679 736	672 133	0,03
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.25% 18 - 29.09.25	700 000	EUR	685 451	677 852	0,03
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.50% 20 - 15.05.30	1 100 000	EUR	1 016 547	992 266	0,04
Bertelsmann SE & Co. KGaA 2.00% 20 - 01.04.28	1 100 000	EUR	1 088 469	1 055 516	0,04
Bertelsmann SE & Co. KGaA 3.50% 22 - 29.05.29	1 100 000	EUR	1 093 210	1 114 509	0,05
Clearstream Banking AG Zero Coupon 20 - 01.12.25	500 000	EUR	476 400	473 280	0,02
Commerzbank AG 0.10% 21 - 11.09.25	860 000	EUR	829 693	815 082	0,03
Commerzbank AG 0.375% 20 - 01.09.27	801 000	EUR	753 918	732 450	0,03
Commerzbank AG 0.50% 19 - 04.12.26	1 152 000	EUR	1 097 053	1 072 996	0,04
Commerzbank AG FRN 20 - 24.03.26	600 000	EUR	579 415	575 982	0,02
Commerzbank AG 0.875% 20 - 22.01.27	800 000	EUR	752 933	743 360	0,03
Commerzbank AG 1.00% 19 - 04.03.26	1 460 000	EUR	1 433 794	1 394 796	0,06
Commerzbank AG 1.125% 17 - 19.09.25	600 000	EUR	580 210	577 644	0,02
Commerzbank AG 1.125% 19 - 22.06.26	500 000	EUR	478 678	473 865	0,02
Commerzbank AG 1.50% 18 - 28.08.28	630 000	EUR	605 716	601 222	0,03
Commerzbank AG 1.875% 18 - 28.02.28	500 000	EUR	474 783	474 710	0,02
Commerzbank AG FRN 22 - 14.09.27	700 000	EUR	680 277	685 244	0,03
Commerzbank AG FRN 22 - 21.03.28	800 000	EUR	792 731	818 696	0,03
Commerzbank AG FRN 23 - 18.01.30	900 000	EUR	904 858	941 841	0,04
Commerzbank AG FRN 23 - 25.03.29	800 000	EUR	799 912	840 280	0,04
Continental AG 0.375% 19 - 27.06.25	882 000	EUR	861 451	847 417	0,04
Continental AG 2.50% 20 - 27.08.26	1 020 000	EUR	1 028 692	1 007 791	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Continental AG 3.625% 22 - 30.11.27	800 000	EUR	797 167	812 864	0,03
Continental AG 4.00% 23 - 01.06.28	1 140 000	EUR	1 140 811	1 176 400	0,05
Continental AG 4.00% 23 - 01.03.27	840 000	EUR	837 677	859 118	0,04
Covestro AG 0.875% 20 - 03.02.26	730 000	EUR	706 166	699 596	0,03
Covestro AG 1.375% 20 - 12.06.30	861 000	EUR	771 835	776 295	0,03
Covestro AG 4.75% 22 - 15.11.28	700 000	EUR	708 675	745 668	0,03
Deutsche Bank AG FRN 21 - 17.02.27	1 600 000	EUR	1 516 716	1 494 096	0,06
Deutsche Bank AG 1.125% 15 - 17.03.25	800 000	EUR	788 118	775 296	0,03
Deutsche Bank AG FRN 20 - 10.06.26	660 000	EUR	650 622	639 712	0,03
Deutsche Bank AG FRN 20 - 03.09.26	900 000	EUR	859 654	861 948	0,04
Deutsche Bank AG FRN 21 - 17.02.32	2 400 000	EUR	2 082 589	1 971 384	0,08
Deutsche Bank AG 1.625% 20 - 20.01.27	2 300 000	EUR	2 230 618	2 161 241	0,09
Deutsche Bank AG 1.75% 18 - 17.01.28	900 000	EUR	844 033	834 399	0,03
Deutsche Bank AG FRN 20 - 19.11.30	2 000 000	EUR	1 739 031	1 738 060	0,07
Deutsche Bank AG FRN 22 - 23.02.28	1 400 000	EUR	1 305 772	1 315 846	0,06
Deutsche Bank AG 2.625% 19 - 12.02.26	800 000	EUR	795 305	784 880	0,03
Deutsche Bank AG 2.75% 15 - 17.02.25	1 390 000	EUR	1 378 907	1 371 986	0,06
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.05.28	500 000	EUR	477 848	489 335	0,02
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.06.32	1 900 000	EUR	1 707 486	1 827 230	0,08
Deutsche Bank AG 4.00% 22 - 29.11.27	900 000	EUR	899 826	925 245	0,04
Deutsche Bank AG 4.50% 16 - 19.05.26	800 000	EUR	790 988	812 064	0,03
Deutsche Bank AG FRN 22 - 05.09.30	1 800 000	EUR	1 766 213	1 859 184	0,08
Deutsche Bank AG FRN 23 - 11.01.29	700 000	EUR	675 135	732 620	0,03
Deutsche Bank AG FRN 20 - 19.05.31	1 500 000	EUR	1 460 517	1 517 565	0,06
Deutsche Boerse AG Zero Coupon 21 - 22.02.26	500 000	EUR	478 919	469 730	0,02
Deutsche Boerse AG 0.125% 21 - 22.02.31	300 000	EUR	257 260	249 123	0,01
Deutsche Boerse AG 1.125% 18 - 26.03.28	610 000	EUR	609 636	574 480	0,02
Deutsche Boerse AG FRN 20 - 16.06.47	900 000	EUR	830 915	813 105	0,03
Deutsche Boerse AG 1.50% 22 - 04.04.32	400 000	EUR	357 491	362 820	0,02
Deutsche Boerse AG 1.625% 15 - 08.10.25	512 000	EUR	514 897	501 069	0,02
Deutsche Boerse AG FRN 22 - 23.06.48	500 000	EUR	456 208	452 170	0,02
Deutsche Boerse AG 3.75% 23 - 28.09.29	1 000 000	EUR	993 654	1 040 020	0,04
Deutsche Boerse AG 3.875% 23 - 28.09.26	1 200 000	EUR	1 199 581	1 226 196	0,05
Deutsche Boerse AG 3.875% 23 - 28.09.33	1 600 000	EUR	1 576 707	1 702 528	0,07
Deutsche Lufthansa AG 2.875% 21 - 11.02.25	1 100 000	EUR	1 088 670	1 078 066	0,05
Deutsche Lufthansa AG 2.875% 21 - 16.05.27	1 300 000	EUR	1 253 379	1 249 053	0,05
Deutsche Lufthansa AG 3.00% 20 - 29.05.26	1 400 000	EUR	1 365 390	1 362 200	0,06
Deutsche Lufthansa AG 3.50% 21 - 14.07.29	700 000	EUR	682 554	681 261	0,03
Deutsche Lufthansa AG 3.75% 21 - 11.02.28	1 200 000	EUR	1 186 882	1 181 832	0,05
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.10% 21 - 02.02.26	500 000	EUR	466 022	447 915	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.25% 21 - 27.10.25	800 000	EUR	744 669	725 392	0,03
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.25% 22 - 17.01.25	700 000	EUR	680 656	662 669	0,03
Deutsche Pfandbriefbank AG 4.375% 22 - 28.08.26	500 000	EUR	492 478	493 725	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 5.00% 23 - 05.02.27	600 000	EUR	607 275	614 460	0,03
Deutsche Post AG 0.375% 20 - 20.05.26	1 170 000	EUR	1 134 945	1 100 701	0,05
Deutsche Post AG 0.75% 20 - 20.05.29	840 000	EUR	817 661	767 609	0,03
Deutsche Post AG 1.00% 17 - 13.12.27	882 000	EUR	851 280	825 499	0,03
Deutsche Post AG 1.00% 20 - 20.05.32	981 000	EUR	888 648	872 668	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Deutsche Post AG 1.25% 16 - 01.04.26	791 000	EUR	774 892	767 863	0,03
Deutsche Post AG 1.625% 18 - 05.12.28	1 220 000	EUR	1 192 666	1 161 672	0,05
Deutsche Post AG 3.375% 23 - 03.07.33	760 000	EUR	753 614	775 975	0,03
Deutsche Telekom AG 0.50% 19 - 05.07.27	1 500 000	EUR	1 425 372	1 399 980	0,06
Deutsche Telekom AG 0.875% 19 - 25.03.26	628 000	EUR	630 658	600 952	0,03
Deutsche Telekom AG 1.375% 19 - 05.07.34	1 410 000	EUR	1 272 233	1 218 635	0,05
Deutsche Telekom AG 1.75% 19 - 25.03.31	1 618 000	EUR	1 619 820	1 520 095	0,06
Deutsche Telekom AG 1.75% 19 - 09.12.49	829 000	EUR	716 160	651 768	0,03
Deutsche Telekom AG 2.25% 19 - 29.03.39	560 000	EUR	516 055	525 168	0,02
Deutsche Wohnen SE 0.50% 21 - 07.04.31	300 000	EUR	257 772	246 768	0,01
Deutsche Wohnen SE 1.00% 20 - 30.04.25	700 000	EUR	691 510	670 432	0,03
Deutsche Wohnen SE 1.30% 21 - 07.04.41	400 000	EUR	351 132	261 204	0,01
Deutsche Wohnen SE 1.50% 20 - 30.04.30	800 000	EUR	740 950	699 280	0,03
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank					
Frankfurt Am Main 0.40% 21 - 17.11.28	200 000	EUR	177 353	170 564	0,01
Eurogrid GmbH 0.741% 21 - 21.04.33	600 000	EUR	530 452	472 998	0,02
Eurogrid GmbH 1.113% 20 - 15.05.32	1 200 000	EUR	1 110 442	1 007 064	0,04
Eurogrid GmbH 1.50% 16 - 18.04.28	1 100 000	EUR	1 075 105	1 028 016	0,04
Eurogrid GmbH 1.875% 15 - 10.06.25	700 000	EUR	698 064	684 222	0,03
Eurogrid GmbH 3.279% 22 - 05.09.31	1 200 000	EUR	1 176 563	1 193 040	0,05
Eurogrid GmbH 3.722% 23 - 27.04.30	1 100 000	EUR	1 097 894	1 121 923	0,05
Evonik Industries AG 0.625% 20 - 18.09.25	900 000	EUR	877 809	859 698	0,04
Evonik Industries AG 0.75% 16 - 07.09.28	510 000	EUR	474 855	468 093	0,02
Evonik Industries AG 2.25% 22 - 25.09.27	1 100 000	EUR	1 068 451	1 063 755	0,04
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 0.625% 19 - 30.11.26	831 000	EUR	784 746	760 390	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.00% 20 - 29.05.26	690 000	EUR	656 059	648 911	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.25% 19 - 29.11.29	570 000	EUR	487 991	496 128	0,02
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 18 - 11.07.25	680 000	EUR	670 784	656 418	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 20 - 29.05.30	1 170 000	EUR	1 072 806	1 009 663	0,04
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 3.875% 22 - 20.09.27	1 040 000	EUR	1 026 418	1 057 597	0,04
Fresenius SE & Co. KGaA 0.375% 20 - 28.09.26	780 000	EUR	743 297	725 010	0,03
Fresenius SE & Co. KGaA 0.75% 20 - 15.01.28	1 180 000	EUR	1 082 077	1 076 349	0,05
Fresenius SE & Co. KGaA 1.125% 20 - 28.01.33	720 000	EUR	620 522	585 871	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 1.625% 20 - 08.10.27	1 177 000	EUR	1 113 697	1 112 818	0,05
Fresenius SE & Co. KGaA 1.875% 19 - 15.02.25	739 000	EUR	736 848	724 456	0,03
Fresenius SE & Co. KGaA 1.875% 22 - 24.05.25	1 051 000	EUR	1 033 154	1 028 319	0,04
Fresenius SE & Co. KGaA 2.875% 19 - 15.02.29	588 000	EUR	562 457	582 708	0,02
Fresenius SE & Co. KGaA 2.875% 22 - 24.05.30	870 000	EUR	824 314	831 511	0,03
Fresenius SE & Co. KGaA 4.25% 22 - 28.05.26	800 000	EUR	798 065	817 864	0,03
Fresenius SE & Co. KGaA 5.00% 22 - 28.11.29	800 000	EUR	802 565	854 040	0,04
Fresenius SE & Co. KGaA 5.125% 23 - 05.10.30	800 000	EUR	825 071	861 392	0,04
Hamburg Commercial Bank AG 0.375% 21 - 09.03.26	500 000	EUR	461 625	459 425	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Hamburg Commercial Bank AG FRN 21 - 22.09.26	500 000	EUR	458 520	460 555	0,02
Hamburg Commercial Bank AG 4.875% 23 - 17.03.25	868 000	EUR	867 881	870 248	0,04
Hamburg Commercial Bank AG 4.875% 23 - 30.03.27	700 000	EUR	697 099	707 623	0,03
Hannover Rueck SE 1.125% 18 - 18.04.28	700 000	EUR	676 730	667 891	0,03
Hannover Rueck SE FRN 19 - 09.10.39	800 000	EUR	714 886	680 072	0,03
Hannover Rueck SE FRN 21 - 30.06.42	900 000	EUR	774 139	726 975	0,03
Hannover Rueck SE FRN 20 - 08.10.40	500 000	EUR	418 647	430 615	0,02
Hannover Rueck SE FRN 14 - 29.06.49	700 000	EUR	715 816	687 589	0,03
Hannover Rueck SE FRN 22 - 26.08.43	900 000	EUR	942 906	1 004 157	0,04
HeidelbergCement AG 1.50% 16 - 07.02.25	1 468 000	EUR	1 458 186	1 440 548	0,06
HeidelbergCement AG 3.75% 23 - 31.05.32	1 070 000	EUR	1 037 091	1 080 754	0,05
Hella GmbH & Co. KGaA 0.50% 19 - 26.01.27	557 000	EUR	522 236	507 538	0,02
Henkel AG & Co. KGaA 0.50% 21 - 17.11.32	600 000	EUR	505 315	497 472	0,02
Henkel AG & Co. KGaA 2.625% 22 - 13.09.27	1 000 000	EUR	983 225	994 310	0,04
HOCHTIEF AG 0.50% 19 - 03.09.27	930 000	EUR	852 396	844 700	0,04
HOCHTIEF AG 0.625% 21 - 26.04.29	618 000	EUR	552 823	534 792	0,02
HOCHTIEF AG 1.75% 18 - 03.07.25	840 000	EUR	831 657	817 127	0,03
Infineon Technologies AG 0.625% 22 - 17.02.25	700 000	EUR	685 754	676 270	0,03
Infineon Technologies AG 1.125% 20 - 24.06.26	1 000 000	EUR	976 121	951 430	0,04
Infineon Technologies AG 1.625% 20 - 24.06.29	1 100 000	EUR	1 031 772	1 019 359	0,04
Infineon Technologies AG 2.00% 20 - 24.06.32	1 000 000	EUR	913 454	908 090	0,04
KION Group AG 1.625% 20 - 24.09.25	700 000	EUR	687 238	666 407	0,03
Knorr-Bremse AG 1.125% 18 - 13.06.25	1 220 000	EUR	1 206 956	1 183 595	0,05
Knorr-Bremse AG 3.25% 22 - 21.09.27	1 000 000	EUR	987 777	1 008 060	0,04
LANXESS AG Zero Coupon 21 - 08.09.27	870 000	EUR	785 209	754 499	0,03
LANXESS AG 0.625% 21 - 01.12.29	800 000	EUR	717 606	650 888	0,03
LANXESS AG 1.00% 16 - 07.10.26	615 000	EUR	592 908	578 961	0,02
LANXESS AG 1.125% 18 - 16.05.25	890 000	EUR	871 929	858 957	0,04
LANXESS AG 1.75% 22 - 22.03.28	900 000	EUR	844 882	824 157	0,03
LEG Immobilien SE 0.375% 22 - 17.01.26	600 000	EUR	581 911	561 660	0,02
LEG Immobilien SE 0.75% 21 - 30.06.31	700 000	EUR	546 981	555 093	0,02
LEG Immobilien SE 0.875% 19 - 28.11.27	700 000	EUR	639 945	633 206	0,03
LEG Immobilien SE 0.875% 21 - 30.03.33	700 000	EUR	610 028	528 269	0,02
LEG Immobilien SE 0.875% 22 - 17.01.29	700 000	EUR	645 408	611 772	0,03
LEG Immobilien SE 1.00% 21 - 19.11.32	500 000	EUR	420 408	389 070	0,02
LEG Immobilien SE 1.50% 22 - 17.01.34	600 000	EUR	537 232	470 748	0,02
LEG Immobilien SE 1.625% 19 - 28.11.34	400 000	EUR	353 636	304 772	0,01
Merck Financial Services GmbH 0.125% 20 - 16.07.25	1 000 000	EUR	972 668	951 740	0,04
Merck Financial Services GmbH 0.375% 19 - 05.07.27	900 000	EUR	854 797	826 659	0,03
Merck Financial Services GmbH 0.50% 20 - 16.07.28	1 100 000	EUR	1 023 364	989 087	0,04
Merck Financial Services GmbH 0.875% 19 - 05.07.31	1 200 000	EUR	1 085 788	1 033 404	0,04
Merck Financial Services GmbH 1.875% 22 - 15.06.26	800 000	EUR	777 502	779 496	0,03
Merck Financial Services GmbH 2.375% 22 - 15.06.30	800 000	EUR	789 576	774 840	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Merck KGaA FRN 20 - 09.09.80	1 300 000	EUR	1 236 851	1 206 101	0,05
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	800 000	EUR	739 925	734 256	0,03
METRO AG 1.50% 15 - 19.03.25	840 000	EUR	827 936	814 724	0,03
Muenchener Hypothekenbank eG 0.375% 21 - 09.03.29	600 000	EUR	497 494	509 106	0,02
Muenchener Hypothekenbank eG 0.50% 19 - 08.06.26	300 000	EUR	276 391	276 642	0,01
Muenchener Hypothekenbank eG 0.875% 18 - 12.09.25	500 000	EUR	475 357	475 045	0,02
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 21 - 26.05.42	1 100 000	EUR	937 004	867 240	0,04
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 20 - 26.05.41	1 500 000	EUR	1 273 512	1 243 275	0,05
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 18 - 26.05.49	1 400 000	EUR	1 402 705	1 355 718	0,06
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 18 - 05.07.25	800 000	EUR	787 474	778 120	0,03
Robert Bosch GmbH 3.625% 23 - 02.06.27	1 100 000	EUR	1 102 086	1 123 419	0,05
Robert Bosch GmbH 3.625% 23 - 02.06.30	1 500 000	EUR	1 498 655	1 539 345	0,06
Robert Bosch GmbH 4.00% 23 - 02.06.35	1 800 000	EUR	1 824 155	1 907 370	0,08
Robert Bosch GmbH 4.375% 23 - 02.06.43	2 200 000	EUR	2 243 567	2 360 578	0,10
Santander Consumer Bank AG 4.375% 23 - 13.09.27	1 000 000	EUR	998 584	1 030 620	0,04
Santander Consumer Bank AG 4.50% 23 - 30.06.26	400 000	EUR	400 115	408 964	0,02
SAP SE 0.125% 20 - 18.05.26	1 000 000	EUR	950 545	940 850	0,04
SAP SE 0.375% 20 - 18.05.29	1 300 000	EUR	1 178 053	1 156 467	0,05
SAP SE 1.00% 15 - 01.04.25	720 000	EUR	718 137	705 017	0,03
SAP SE 1.00% 18 - 13.03.26	800 000	EUR	784 756	770 856	0,03
SAP SE 1.25% 18 - 10.03.28	1 500 000	EUR	1 476 400	1 421 235	0,06
SAP SE 1.375% 18 - 13.03.30	700 000	EUR	692 973	647 983	0,03
SAP SE 1.625% 18 - 10.03.31	1 800 000	EUR	1 775 546	1 679 166	0,07
SAP SE 1.75% 14 - 22.02.27	1 370 000	EUR	1 391 137	1 358 328	0,06
Talanx AG FRN 21 - 01.12.42	600 000	EUR	500 699	496 170	0,02
Talanx AG FRN 17 - 05.12.47	900 000	EUR	847 318	839 340	0,04
Talanx AG 2.50% 14 - 23.07.26	500 000	EUR	505 139	490 920	0,02
Talanx AG 4.00% 22 - 25.10.29	600 000	EUR	603 879	624 918	0,03
Vonovia SE Zero Coupon 21 - 01.12.25	1 500 000	EUR	1 453 776	1 398 585	0,06
Vonovia SE 0.25% 21 - 01.09.28	1 500 000	EUR	1 327 182	1 273 620	0,05
Vonovia SE 0.375% 21 - 16.06.27	1 200 000	EUR	1 129 139	1 072 800	0,04
Vonovia SE 0.625% 21 - 24.03.31	700 000	EUR	545 461	551 614	0,02
Vonovia SE 0.625% 21 - 14.12.29	1 100 000	EUR	996 889	907 313	0,04
Vonovia SE 0.75% 21 - 01.09.32	1 300 000	EUR	1 070 831	987 805	0,04
Vonovia SE 1.00% 21 - 16.06.33	1 100 000	EUR	951 423	835 329	0,03
Vonovia SE 1.375% 22 - 28.01.26	800 000	EUR	780 842	764 592	0,03
Vonovia SE 1.50% 21 - 14.06.41	600 000	EUR	454 101	390 180	0,02
Vonovia SE 1.625% 21 - 01.09.51	900 000	EUR	729 696	520 839	0,02
Vonovia SE 1.875% 22 - 28.06.28	800 000	EUR	734 446	739 104	0,03
Vonovia SE 2.375% 22 - 25.03.32	900 000	EUR	845 198	789 102	0,03
Vonovia SE 4.75% 22 - 23.05.27	900 000	EUR	907 475	933 291	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Vonovia SE 5.00% 22 - 23.11.30	900 000	EUR	903 755	951 345	0,04
WPP Finance Deutschland GmbH 1.625% 15 - 23.03.30	940 000	EUR	869 862	856 453	0,04
			195 390 292	192 907 468	8,06
Guernesey					
Sirius Real Estate Ltd. 1.125% 21 - 22.06.26	600 000	EUR	546 449	540 978	0,02
Sirius Real Estate Ltd. 1.75% 21 - 24.11.28	300 000	EUR	260 407	247 971	0,01
			806 856	788 949	0,03
Hong Kong					
AIA Group Ltd. FRN 21 - 09.09.33	870 000	EUR	750 513	742 066	0,03
			750 513	742 066	0,03
Hongrie					
Erste Bank Hungary Zrt FRN 22 - 04.02.26	300 000	EUR	290 399	286 197	0,01
OTP Bank Nyrt FRN 23 - 05.10.27	900 000	EUR	899 071	930 663	0,04
OTP Bank Nyrt FRN 22 - 04.03.26	700 000	EUR	701 365	718 599	0,03
			1 890 835	1 935 459	0,08
Islande					
Arion Banki HF 7.25% 23 - 25.05.26	200 000	EUR	211 048	210 616	0,01
			211 048	210 616	0,01
Irlande					
Abbott Ireland Financing Dac 0.375% 19 - 19.11.27	900 000	EUR	814 279	824 310	0,04
Abbott Ireland Financing Dac 1.50% 18 - 27.09.26	1 590 000	EUR	1 533 853	1 534 429	0,06
AIB Group PLC FRN 21 - 17.11.27	820 000	EUR	760 777	752 416	0,03
AIB Group PLC 2.25% 18 - 03.07.25	670 000	EUR	660 445	658 369	0,03
AIB Group PLC FRN 22 - 04.04.28	1 020 000	EUR	967 683	978 170	0,04
AIB Group PLC FRN 22 - 04.07.26	960 000	EUR	954 017	960 038	0,04
AIB Group PLC FRN 23 - 23.07.29	760 000	EUR	758 285	784 221	0,03
AIB Group PLC FRN 23 - 23.10.31	982 000	EUR	989 553	1 060 756	0,04
AIB Group PLC FRN 22 - 16.02.29	1 040 000	EUR	1 062 072	1 117 834	0,05
Atlas Copco Finance Dac 0.125% 19 - 03.09.29	600 000	EUR	525 697	515 226	0,02
Atlas Copco Finance Dac 0.75% 22 - 08.02.32	630 000	EUR	543 306	529 011	0,02
Bank of Ireland Group PLC FRN 21 - 10.05.27	800 000	EUR	722 787	743 688	0,03
Bank of Ireland Group PLC FRN 21 - 11.08.31	440 000	EUR	392 024	410 309	0,02
Bank of Ireland Group PLC FRN 22 - 05.06.26	1 200 000	EUR	1 150 727	1 167 060	0,05
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 13.11.29	900 000	EUR	910 643	935 109	0,04
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 16.07.28	980 000	EUR	981 722	1 024 600	0,04
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 04.07.31	900 000	EUR	898 762	960 201	0,04
Bank of Ireland Group PLC FRN 22 - 01.03.33	640 000	EUR	668 314	691 571	0,03
CA Auto Bank SpA 4.375% 23 - 08.06.26	980 000	EUR	980 610	995 455	0,04
CA Auto Bank SpA 4.75% 23 - 25.01.27	964 000	EUR	968 459	995 995	0,04
CCEP Finance Ireland Dac Zero Coupon 21 - 06.09.25	1 215 000	EUR	1 162 774	1 149 123	0,05
CCEP Finance Ireland Dac 0.50% 21 - 06.09.29	870 000	EUR	811 683	753 464	0,03
CCEP Finance Ireland Dac 0.875% 21 - 06.05.33	1 600 000	EUR	1 394 054	1 292 624	0,05
CCEP Finance Ireland Dac 1.50% 21 - 06.05.41	1 080 000	EUR	888 764	800 960	0,03
CRH Finance Dac 1.375% 16 - 18.10.28	740 000	EUR	706 382	684 470	0,03
CRH SMW Finance Dac 1.25% 20 - 05.11.26	1 110 000	EUR	1 099 507	1 057 608	0,04
CRH SMW Finance DAC 4.00% 23 - 11.07.27	700 000	EUR	703 783	719 320	0,03
CRH SMW Finance DAC 4.00% 23 - 11.07.31	1 100 000	EUR	1 094 179	1 142 416	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
CRH SMW Finance DAC 4.25% 23 - 11.07.35	1 130 000	EUR	1 125 529	1 187 460	0,05
Dell Bank International Dac 0.50% 21 - 27.10.26	850 000	EUR	803 833	786 352	0,03
Dell Bank International Dac 4.50% 22 - 18.10.27	610 000	EUR	606 587	635 468	0,03
DXC Capital Funding Dac 0.45% 21 - 15.09.27	1 050 000	EUR	936 310	932 064	0,04
DXC Capital Funding Dac 0.95% 21 - 15.09.31	950 000	EUR	800 117	760 608	0,03
Eaton Capital UnLtd Co. 0.128% 21 - 08.03.26	1 470 000	EUR	1 408 223	1 379 580	0,06
Eaton Capital UnLtd Co. 0.577% 21 - 08.03.30	740 000	EUR	654 776	638 923	0,03
Eaton Capital UnLtd Co. 0.697% 19 - 14.05.25	800 000	EUR	783 879	770 704	0,03
Experian Europe Dac 1.56% 22 - 16.05.31	600 000	EUR	511 422	540 198	0,02
Fresenius Finance Ireland PLC Zero Coupon 21 - 01.10.25	580 000	EUR	548 328	546 163	0,02
Fresenius Finance Ireland PLC 0.50% 21 - 01.10.28	650 000	EUR	583 956	575 946	0,02
Fresenius Finance Ireland PLC 0.875% 21 - 01.10.31	820 000	EUR	692 345	662 929	0,03
Fresenius Finance Ireland PLC 2.125% 17 - 01.02.27	1 099 000	EUR	1 094 161	1 063 162	0,04
Fresenius Finance Ireland PLC 3.00% 17 - 30.01.32	669 000	EUR	641 984	633 677	0,03
GE Capital European Funding Unlimited Co. 6.025% 08 - 01.03.38	675 000	EUR	801 424	843 061	0,04
Hammerson Ireland Finance Dac 1.75% 21 - 03.06.27	750 000	EUR	672 963	686 730	0,03
Johnson Controls International PLC 1.375% 16 - 25.02.25	650 000	EUR	637 250	632 164	0,03
Johnson Controls International PLC 4.25% 23 - 23.05.35	1 150 000	EUR	1 158 861	1 218 988	0,05
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 0.375% 20 - 15.09.27	850 000	EUR	766 352	767 261	0,03
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 1.00% 20 - 15.09.32	620 000	EUR	552 785	516 671	0,02
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 3.00% 22 - 15.09.28	960 000	EUR	933 927	956 074	0,04
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 0.625% 19 - 20.09.29	1 020 000	EUR	925 406	899 008	0,04
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 0.875% 21 - 01.12.31	1 050 000	EUR	910 150	890 200	0,04
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 2.375% 15 - 10.09.25	1 567 000	EUR	1 576 561	1 546 002	0,07
Linde PLC Zero Coupon 21 - 30.09.26	1 000 000	EUR	941 929	923 350	0,04
Linde PLC 0.375% 21 - 30.09.33	600 000	EUR	560 110	466 572	0,02
Linde PLC 1.00% 21 - 30.09.51	1 000 000	EUR	718 885	605 990	0,03
Linde PLC 1.00% 22 - 31.03.27	600 000	EUR	577 061	567 132	0,02
Linde PLC 1.375% 22 - 31.03.31	1 300 000	EUR	1 161 472	1 172 015	0,05
Linde PLC 1.625% 22 - 31.03.35	1 100 000	EUR	949 337	944 416	0,04
Linde PLC 3.375% 23 - 12.06.29	1 100 000	EUR	1 092 652	1 130 107	0,05
Linde PLC 3.625% 23 - 12.06.25	700 000	EUR	698 594	704 256	0,03
Linde PLC 3.625% 23 - 12.06.34	1 000 000	EUR	993 051	1 046 970	0,04
Ryanair Dac 0.875% 21 - 25.05.26	1 820 000	EUR	1 704 161	1 718 153	0,07
Ryanair Dac 2.875% 20 - 15.09.25	1 300 000	EUR	1 284 006	1 287 429	0,05
Securitas Treasury Ireland DAC 4.25% 23 - 04.04.27	980 000	EUR	981 648	998 708	0,04
Securitas Treasury Ireland DAC 4.375% 23 - 06.03.29	860 000	EUR	860 449	889 335	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.875% 18 - 15.01.26	1 501 000	EUR	1 503 888	1 478 770	0,06
Smurfit Kappa Treasury ULC 0.50% 21 - 22.09.29	840 000	EUR	714 282	718 435	0,03
Smurfit Kappa Treasury ULC 1.00% 21 - 22.09.33	610 000	EUR	521 156	487 018	0,02
Smurfit Kappa Treasury ULC 1.50% 19 - 15.09.27	1 177 000	EUR	1 122 560	1 105 191	0,05
Vodafone International Financing Dac 3.25% 22 - 02.03.29	980 000	EUR	957 045	992 270	0,04
Vodafone International Financing Dac 3.75% 22 - 02.12.34	960 000	EUR	935 450	990 288	0,04
Vodafone International Financing Dac 4.00% 23 - 10.02.43	800 000	EUR	736 500	810 432	0,03
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 1.625% 19 - 17.06.39	450 000	EUR	387 143	363 690	0,02
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. FRN 20 - 17.09.50	970 000	EUR	860 596	844 259	0,04
			65 494 245	65 552 932	2,74
Italie					
Aeroporti di Roma SpA 1.625% 17 - 08.06.27	600 000	EUR	568 210	575 526	0,02
Aeroporti di Roma SpA 1.625% 20 - 02.02.29	499 000	EUR	439 571	457 942	0,02
Aeroporti di Roma SpA 1.75% 21 - 30.07.31	590 000	EUR	490 228	508 834	0,02
Aeroporti di Roma SpA 4.875% 23 - 10.07.33	650 000	EUR	646 803	684 099	0,03
Anima Holdings SpA 1.50% 21 - 22.04.28	370 000	EUR	324 136	332 989	0,01
Assicurazioni Generali SpA 1.713% 21 - 30.06.32	640 000	EUR	510 998	515 405	0,02
Assicurazioni Generali SpA 2.124% 19 - 01.10.30	810 000	EUR	729 524	713 578	0,03
Assicurazioni Generali SpA 2.429% 20 - 14.07.31	730 000	EUR	645 163	637 502	0,03
Assicurazioni Generali SpA 3.875% 19 - 29.01.29	470 000	EUR	462 242	475 038	0,02
Assicurazioni Generali SpA 4.125% 14 - 04.05.26	1 100 000	EUR	1 136 717	1 107 326	0,05
Assicurazioni Generali SpA FRN 14 - 30.11.49	1 100 000	EUR	1 118 071	1 094 907	0,05
Assicurazioni Generali SpA FRN 16 - 08.06.48	1 040 000	EUR	1 083 719	1 071 502	0,04
Assicurazioni Generali SpA 5.272% 23 - 12.09.33	600 000	EUR	583 272	632 508	0,03
Assicurazioni Generali SpA 5.399% 23 - 20.04.33	700 000	EUR	703 382	742 938	0,03
Assicurazioni Generali SpA FRN 15 - 27.10.47	1 590 000	EUR	1 709 275	1 651 883	0,07
Assicurazioni Generali SpA 5.80% 22 - 06.07.32	500 000	EUR	518 779	539 280	0,02
ASTM SpA 1.00% 21 - 25.11.26	1 080 000	EUR	1 024 567	1 006 722	0,04
ASTM SpA 1.50% 21 - 25.01.30	1 730 000	EUR	1 517 952	1 504 183	0,06
ASTM SpA 1.625% 18 - 08.02.28	732 000	EUR	672 156	686 579	0,03
ASTM SpA 2.375% 21 - 25.11.33	1 530 000	EUR	1 265 636	1 283 731	0,05
Banca Mediolanum SpA FRN 22 - 22.01.27	300 000	EUR	302 381	309 267	0,01
Banco BPM SpA 0.875% 21 - 15.07.26	400 000	EUR	370 498	375 012	0,02
Banco BPM SpA 1.75% 19 - 28.01.25	200 000	EUR	194 874	195 378	0,01
Banco BPM SpA 4.625% 23 - 29.11.27	1 400 000	EUR	1 414 305	1 443 148	0,06
Banco BPM SpA 4.875% 23 - 18.01.27	600 000	EUR	613 036	619 374	0,03
Credito Emiliano SpA FRN 22 - 19.01.28	600 000	EUR	568 344	555 870	0,02
Credito Emiliano SpA FRN 23 - 26.03.30	650 000	EUR	641 797	670 742	0,03
FinecoBank Banca Fineco SpA FRN 21 - 21.10.27	570 000	EUR	523 854	518 974	0,02
FinecoBank Banca Fineco SpA FRN 23 - 23.02.29	250 000	EUR	248 348	254 903	0,01
Genertel SpA FRN 17 - 14.12.47	400 000	EUR	394 983	396 976	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 0.625% 21 - 24.02.26	1 440 000	EUR	1 370 600	1 353 658	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.75% 21 - 16.03.28	1 530 000	EUR	1 405 311	1 378 193	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 19.11.26	1 460 000	EUR	1 394 188	1 368 633	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 1.35% 21 - 24.02.31	790 000	EUR	691 759	647 397	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 1.625% 19 - 21.04.25	520 000	EUR	520 626	507 380	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 18 - 20.03.28	1 510 000	EUR	1 434 295	1 409 993	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 19 - 04.07.29	1 068 000	EUR	1 017 717	972 959	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 20 - 26.05.25	1 540 000	EUR	1 524 748	1 509 246	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23 - 19.05.26	1 200 000	EUR	1 197 326	1 217 568	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 4.375% 23 - 29.08.27	800 000	EUR	802 176	821 024	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 4.75% 22 - 06.09.27	1 170 000	EUR	1 169 850	1 212 822	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 4.875% 23 - 19.05.30	1 540 000	EUR	1 546 857	1 619 757	0,07
Intesa Sanpaolo SpA FRN 23 - 08.03.28	1 740 000	EUR	1 733 577	1 800 100	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 5.125% 23 - 29.08.31	1 780 000	EUR	1 807 415	1 899 509	0,08
Intesa Sanpaolo SpA 5.25% 22 - 13.01.30	870 000	EUR	887 426	933 292	0,04
Intesa Sanpaolo SpA 5.625% 23 - 08.03.33	850 000	EUR	847 760	915 339	0,04
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.75% 20 - 15.07.27	380 000	EUR	354 575	346 066	0,01
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 21 - 02.11.28	600 000	EUR	535 267	538 284	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.875% 19 - 15.01.26	670 000	EUR	649 795	637 438	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.00% 20 - 08.09.27	662 000	EUR	627 849	610 053	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 22 - 17.07.29	530 000	EUR	467 916	473 030	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.125% 19 - 15.07.25	470 000	EUR	459 810	452 394	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.125% 20 - 23.04.25	650 000	EUR	635 740	626 860	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.625% 19 - 07.01.25	580 000	EUR	569 450	566 712	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 01.02.30	610 000	EUR	608 234	628 263	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 22 - 07.02.29	510 000	EUR	510 058	530 808	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 14.03.28	890 000	EUR	888 761	919 744	0,04
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 13.09.27	590 000	EUR	589 761	606 561	0,02
Pirelli & C SpA 4.25% 23 - 18.01.28	900 000	EUR	893 513	934 569	0,04
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.125% 19 - 25.07.25	680 000	EUR	658 049	645 089	0,03
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.375% 20 - 25.09.30	750 000	EUR	635 318	620 648	0,03
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.375% 21 - 23.06.29	800 000	EUR	719 254	690 720	0,03
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.75% 20 - 24.07.32	730 000	EUR	645 332	595 052	0,02
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.00% 16 - 11.10.28	940 000	EUR	902 102	856 782	0,04
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.00% 19 - 10.04.26	750 000	EUR	729 677	715 463	0,03
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.375% 17 - 26.07.27	1 570 000	EUR	1 521 609	1 479 631	0,06
Terna - Rete Elettrica Nazionale 3.625% 23 - 21.04.29	1 150 000	EUR	1 138 684	1 173 736	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Terna - Rete Elettrica Nazionale 3.875% 23 - 24.07.33	960 000	EUR	948 976	989 798	0,04
UniCredit SpA 0.325% 21 - 19.01.26	1 120 000	EUR	1 079 616	1 054 603	0,04
UniCredit SpA 0.50% 19 - 09.04.25	1 060 000	EUR	1 032 314	1 018 575	0,04
UniCredit SpA FRN 21 - 05.07.29	1 090 000	EUR	986 502	969 141	0,04
UniCredit SpA 0.85% 21 - 19.01.31	1 080 000	EUR	900 097	890 417	0,04
UniCredit SpA FRN 22 - 18.01.28	1 530 000	EUR	1 411 822	1 420 666	0,06
UniCredit SpA FRN 20 - 20.01.26	1 433 000	EUR	1 393 576	1 390 898	0,06
UniCredit SpA FRN 20 - 16.06.26	1 540 000	EUR	1 505 946	1 486 454	0,06
UniCredit SpA 1.625% 22 - 18.01.32	600 000	EUR	503 969	512 928	0,02
UniCredit SpA 1.80% 20 - 20.01.30	850 000	EUR	788 494	762 858	0,03
UniCredit SpA 2.125% 16 - 24.10.26	990 000	EUR	991 834	964 715	0,04
UniCredit SpA FRN 20 - 22.07.27	1 480 000	EUR	1 423 217	1 429 724	0,06
UniCredit SpA FRN 23 - 16.02.29	1 150 000	EUR	1 110 422	1 176 496	0,05
UniCredit SpA FRN 23 - 14.02.30	1 050 000	EUR	1 048 838	1 095 937	0,05
UniCredit SpA FRN 23 - 17.01.29	1 200 000	EUR	1 205 430	1 255 944	0,05
UniCredit SpA FRN 22 - 15.11.27	1 240 000	EUR	1 267 173	1 313 693	0,05
			73 113 432	73 509 736	3,07
Japon					
East Japan Railway Co. 0.773% 21 - 15.09.34	580 000	EUR	479 547	455 903	0,02
East Japan Railway Co. 1.104% 21 - 15.09.39	1 000 000	EUR	835 090	720 990	0,03
East Japan Railway Co. 1.85% 22 - 13.04.33	920 000	EUR	828 113	823 198	0,03
East Japan Railway Co. 2.614% 22 - 08.09.25	1 080 000	EUR	1 066 682	1 067 591	0,04
East Japan Railway Co. 3.245% 22 - 08.09.30	650 000	EUR	631 568	657 755	0,03
East Japan Railway Co. 3.976% 23 - 05.09.32	1 030 000	EUR	1 031 399	1 096 373	0,05
East Japan Railway Co. 4.11% 23 - 22.02.43	1 190 000	EUR	1 156 449	1 256 997	0,05
East Japan Railway Co. 4.389% 23 - 05.09.43	1 020 000	EUR	1 015 793	1 108 312	0,05
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 21 - 08.06.27	560 000	EUR	525 031	520 486	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.848% 19 - 19.07.29	400 000	EUR	360 392	358 420	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 3.556% 22 - 15.06.32	1 020 000	EUR	1 010 253	1 043 154	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 23 - 07.06.31	600 000	EUR	604 854	633 474	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.184% 21 - 13.04.26	900 000	EUR	869 559	839 376	0,04
Mizuho Financial Group Inc. 0.214% 20 - 07.10.25	730 000	EUR	690 691	692 828	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.402% 19 - 06.09.29	450 000	EUR	385 761	378 774	0,02
Mizuho Financial Group Inc. FRN 21 - 06.09.29	1 060 000	EUR	970 320	915 469	0,04
Mizuho Financial Group Inc. 0.693% 20 - 07.10.30	1 300 000	EUR	1 146 415	1 082 588	0,05
Mizuho Financial Group Inc. 0.797% 20 - 15.04.30	950 000	EUR	824 622	805 819	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.843% 21 - 12.04.33	770 000	EUR	622 093	621 937	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 1.598% 18 - 10.04.28	630 000	EUR	586 830	591 740	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 1.631% 22 - 08.04.27	1 070 000	EUR	1 009 143	1 013 108	0,04
Mizuho Financial Group Inc. 2.096% 22 - 08.04.32	890 000	EUR	832 074	798 116	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 3.49% 22 - 05.09.27	900 000	EUR	887 528	903 204	0,04
Mizuho Financial Group Inc. 4.029% 22 - 05.09.32	670 000	EUR	659 235	690 435	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 4.157% 23 - 20.05.28	690 000	EUR	687 795	708 044	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 4.416% 23 - 20.05.33	890 000	EUR	883 237	936 262	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Mizuho Financial Group Inc. 4.608% 23 - 28.08.30	790 000	EUR	801 493	836 910	0,03
Nidec Corp. 0.046% 21 - 30.03.26	840 000	EUR	797 465	775 169	0,03
Nissan Motor Co. Ltd. 2.652% 20 - 17.03.26	1 200 000	EUR	1 148 713	1 171 308	0,05
Nissan Motor Co. Ltd. 3.201% 20 - 17.09.28	1 000 000	EUR	913 354	959 630	0,04
NTT Finance Corp. 0.01% 21 - 03.03.25	1 308 000	EUR	1 271 143	1 255 418	0,05
NTT Finance Corp. 0.082% 21 - 13.12.25	1 010 000	EUR	962 989	951 440	0,04
NTT Finance Corp. 0.342% 21 - 03.03.30	1 520 000	EUR	1 370 737	1 307 732	0,05
NTT Finance Corp. 0.399% 21 - 13.12.28	1 310 000	EUR	1 178 087	1 163 621	0,05
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.303% 20 - 28.10.27	480 000	EUR	441 067	431 122	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.632% 19 - 23.10.29	1 540 000	EUR	1 376 122	1 317 609	0,06
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.413% 17 - 14.06.27	570 000	EUR	542 737	535 173	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.546% 16 - 15.06.26	1 900 000	EUR	1 869 218	1 821 739	0,08
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 4.492% 23 - 12.06.30	660 000	EUR	665 939	695 897	0,03
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0.75% 20 - 09.07.27	1 020 000	EUR	955 377	944 673	0,04
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.00% 20 - 09.07.29	1 210 000	EUR	1 112 439	1 078 170	0,05
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1.375% 20 - 09.07.32	1 470 000	EUR	1 345 526	1 257 761	0,05
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.00% 20 - 09.07.40	1 505 000	EUR	1 293 546	1 194 037	0,05
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.25% 18 - 21.11.26	2 060 000	EUR	2 050 595	2 012 661	0,08
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.00% 18 - 21.11.30	2 250 000	EUR	2 291 489	2 219 197	0,09
			42 988 510	42 649 620	1,78
Jersey					
Aptiv PLC 1.50% 15 - 10.03.25	1 090 000	EUR	1 077 157	1 061 431	0,04
Aptiv PLC 1.60% 16 - 15.09.28	610 000	EUR	570 338	568 612	0,02
Heathrow Funding Ltd. 1.125% 21 - 08.10.30	750 000	EUR	657 720	641 580	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.50% 15 - 11.02.30	1 080 000	EUR	983 123	961 729	0,04
Heathrow Funding Ltd. 1.50% 20 - 12.10.25	1 070 000	EUR	1 060 702	1 036 455	0,04
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 17 - 12.07.32	700 000	EUR	631 887	612 374	0,03
Heathrow Funding Ltd. 1.875% 19 - 14.03.34	980 000	EUR	813 075	825 670	0,04
Heathrow Funding Ltd. 4.50% 23 - 11.07.33	1 000 000	EUR	999 883	1 064 010	0,04
			6 793 885	6 771 861	0,28
Liechtenstein					
Swiss Life Finance I Ltd. 0.50% 21 - 15.09.31	690 000	EUR	610 746	559 535	0,02
Swiss Life Finance I Ltd. 3.25% 22 - 31.08.29	890 000	EUR	868 622	891 878	0,04
			1 479 368	1 451 413	0,06
Luxembourg					
Acef Holdings SCA 0.75% 21 - 14.06.28	590 000	EUR	532 389	507 506	0,02
Acef Holdings SCA 1.25% 21 - 26.04.30	570 000	EUR	483 133	457 020	0,02
Aroundtown SA Zero Coupon 20 - 16.07.26	900 000	EUR	819 497	755 505	0,03
Aroundtown SA 0.375% 21 - 15.04.27	1 200 000	EUR	1 070 909	964 500	0,04
Aroundtown SA 0.625% 19 - 09.07.25	700 000	EUR	664 627	647 066	0,03
Aroundtown SA 1.00% 17 - 07.01.25	500 000	EUR	487 929	476 245	0,02
Aroundtown SA 1.45% 19 - 09.07.28	700 000	EUR	593 347	545 538	0,02
Aroundtown SA 1.50% 19 - 28.05.26	600 000	EUR	561 522	535 200	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Aroundtown SA 1.625% 18 - 31.01.28	900 000	EUR	817 352	730 737	0,03
Aroundtown SA FRN 21 - 31.12.99	700 000	EUR	489 208	225 904	0,01
Aroundtown SA FRN 19 - 31.12.99	610 000	EUR	518 766	213 848	0,01
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 21 - 13.08.28	1 200 000	EUR	1 089 686	1 056 696	0,04
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 19 - 04.06.26	840 000	EUR	808 809	801 856	0,03
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.213% 21 - 12.02.36	780 000	EUR	630 487	603 463	0,03
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.336% 21 - 13.08.41	1 370 000	EUR	1 052 165	942 217	0,04
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 3.553% 23 - 13.09.29	1 350 000	EUR	1 318 925	1 378 093	0,06
CNH Industrial Finance Europe SA 1.625% 19 - 03.07.29	650 000	EUR	610 875	591 526	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 17 - 12.09.25	1 050 000	EUR	1 027 181	1 021 818	0,04
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 19 - 25.03.27	840 000	EUR	807 272	804 308	0,03
CNH Industrial Finance Europe SA 1.875% 18 - 19.01.26	680 000	EUR	664 804	660 525	0,03
CPI Property Group SA 1.50% 21 - 27.01.31	900 000	EUR	570 244	468 657	0,02
CPI Property Group SA 1.625% 19 - 23.04.27	800 000	EUR	618 505	586 040	0,02
CPI Property Group SA 1.75% 22 - 14.01.30	950 000	EUR	655 366	541 510	0,02
CPI Property Group SA 2.75% 20 - 12.05.26	400 000	EUR	342 172	332 804	0,01
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl 2.125% 20 - 19.11.25	465 000	EUR	426 133	436 691	0,02
DH Europe Finance II Sarl 0.20% 19 - 18.03.26	1 830 000	EUR	1 764 607	1 717 912	0,07
DH Europe Finance II Sarl 0.45% 19 - 18.03.28	1 830 000	EUR	1 673 072	1 653 149	0,07
DH Europe Finance II Sarl 0.75% 19 - 18.09.31	2 540 000	EUR	2 275 010	2 140 839	0,09
DH Europe Finance II Sarl 1.35% 19 - 18.09.39	1 860 000	EUR	1 475 134	1 404 932	0,06
DH Europe Finance II Sarl 1.80% 19 - 18.09.49	1 050 000	EUR	859 503	762 961	0,03
DH Europe Finance Sarl 1.20% 17 - 30.06.27	940 000	EUR	898 206	887 473	0,04
Eurofins Scientific SE 0.875% 21 - 19.05.31	1 080 000	EUR	902 099	878 267	0,04
Eurofins Scientific SE 3.75% 20 - 17.07.26	590 000	EUR	602 888	596 773	0,03
Eurofins Scientific SE 4.00% 22 - 06.07.29	850 000	EUR	846 231	861 126	0,04
Eurofins Scientific SE 4.75% 23 - 06.09.30	840 000	EUR	839 964	884 680	0,04
GELF Bond Issuer I SA 1.125% 19 - 18.07.29	400 000	EUR	348 959	339 304	0,01
GELF Bond Issuer I SA 1.625% 16 - 20.10.26	400 000	EUR	382 633	380 252	0,02
Grand City Properties SA 0.125% 21 - 11.01.28	1 200 000	EUR	1 051 912	1 007 028	0,04
Grand City Properties SA 1.375% 17 - 03.08.26	600 000	EUR	557 998	552 912	0,02
Grand City Properties SA 1.50% 18 - 22.02.27	800 000	EUR	749 071	722 400	0,03
Grand City Properties SA FRN 20 - 31.12.99	800 000	EUR	651 582	360 160	0,02
Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA 4.875% 23 - 21.11.33	1 107 000	EUR	1 090 173	1 179 354	0,05
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.125% 19 - 01.12.27	1 080 000	EUR	1 010 142	1 020 136	0,04
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.50% 17 - 14.06.27	577 000	EUR	567 770	553 660	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.625% 17 - 07.04.26	1 500 000	EUR	1 467 288	1 457 235	0,06
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.75% 18 - 24.04.28	1 029 000	EUR	976 827	981 409	0,04
Helvetia Europe SA FRN 20 - 30.09.41	684 000	EUR	599 552	592 720	0,02
Highland Holdings Sarl 0.318% 21 - 15.12.26	1 030 000	EUR	957 764	950 309	0,04
Highland Holdings Sarl 0.934% 21 - 15.12.31	620 000	EUR	543 742	512 449	0,02
Holcim Finance Luxembourg SA 0.125% 21 - 19.07.27	870 000	EUR	792 282	788 725	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 19 - 29.11.26	840 000	EUR	787 401	782 897	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 20 - 23.04.31	1 330 000	EUR	1 163 099	1 082 873	0,05
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 21 - 03.09.30	1 310 000	EUR	1 135 421	1 087 693	0,05
Holcim Finance Luxembourg SA 0.625% 21 - 19.01.33	790 000	EUR	637 308	616 848	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 0.625% 21 - 06.04.30	740 000	EUR	656 863	627 831	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 1.50% 22 - 06.04.25	730 000	EUR	717 556	711 057	0,03
Holcim Finance Luxembourg SA 1.75% 17 - 29.08.29	1 180 000	EUR	1 110 400	1 088 172	0,05
Holcim Finance Luxembourg SA 2.25% 16 - 26.05.28	1 490 000	EUR	1 471 240	1 444 257	0,06
Holcim Finance Luxembourg SA 2.375% 20 - 09.04.25	770 000	EUR	770 329	759 928	0,03
John Deere Bank SA 2.50% 22 - 14.09.26	880 000	EUR	862 950	870 267	0,04
John Deere Cash Management SARL 1.65% 19 - 13.06.39	920 000	EUR	838 046	742 909	0,03
John Deere Cash Management SARL 1.85% 20 - 02.04.28	1 046 000	EUR	1 059 082	1 010 488	0,04
John Deere Cash Management SARL 2.20% 20 - 02.04.32	886 000	EUR	868 951	836 393	0,04
Medtronic Global Holdings SCA Zero Coupon 20 - 15.10.25	1 500 000	EUR	1 414 327	1 417 725	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 0.25% 19 - 02.07.25	1 500 000	EUR	1 435 127	1 431 270	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 20 - 15.10.28	1 440 000	EUR	1 247 710	1 280 938	0,05
Medtronic Global Holdings SCA 0.75% 20 - 15.10.32	1 440 000	EUR	1 133 860	1 186 358	0,05
Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 19 - 02.07.31	1 400 000	EUR	1 170 422	1 210 188	0,05
Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 19 - 07.03.27	2 240 000	EUR	2 093 585	2 117 360	0,09
Medtronic Global Holdings SCA 1.375% 20 - 15.10.40	1 440 000	EUR	986 274	1 055 736	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 1.50% 19 - 02.07.39	1 340 000	EUR	967 197	1 021 830	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 1.625% 19 - 07.03.31	1 540 000	EUR	1 355 857	1 394 809	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 1.625% 20 - 15.10.50	1 340 000	EUR	830 476	912 044	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 1.75% 19 - 02.07.49	1 590 000	EUR	1 038 431	1 116 959	0,05
Medtronic Global Holdings SCA 2.25% 19 - 07.03.39	1 600 000	EUR	1 273 628	1 363 648	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 2.625% 22 - 15.10.25	670 000	EUR	660 973	661 324	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.00% 22 - 15.10.28	1 500 000	EUR	1 470 193	1 503 975	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 3.125% 22 - 15.10.31	1 540 000	EUR	1 478 630	1 545 313	0,06
Medtronic Global Holdings SCA 3.375% 22 - 15.10.34	1 400 000	EUR	1 342 054	1 412 572	0,06
Mohawk Capital Finance SA 1.75% 20 - 12.06.27	900 000	EUR	836 590	850 878	0,04
Novartis Finance SA Zero Coupon 20 - 23.09.28	3 010 000	EUR	2 772 472	2 663 007	0,11
Novartis Finance SA 0.625% 16 - 20.09.28	620 000	EUR	604 779	569 923	0,02
Novartis Finance SA 1.125% 17 - 30.09.27	790 000	EUR	771 038	753 905	0,03
Novartis Finance SA 1.375% 18 - 14.08.30	1 080 000	EUR	1 039 616	992 304	0,04
Novartis Finance SA 1.625% 14 - 09.11.26	850 000	EUR	845 481	829 583	0,03
Novartis Finance SA 1.70% 18 - 14.08.38	1 030 000	EUR	909 489	885 851	0,04
Richemont International Holdings SA 0.75% 20 - 26.05.28	720 000	EUR	653 672	660 766	0,03
Richemont International Holdings SA 1.00% 18 - 26.03.26	2 250 000	EUR	2 154 907	2 157 120	0,09
Richemont International Holdings SA 1.125% 20 - 26.05.32	1 300 000	EUR	1 102 446	1 126 346	0,05
Richemont International Holdings SA 1.50% 18 - 26.03.30	1 790 000	EUR	1 630 268	1 655 571	0,07
Richemont International Holdings SA 1.625% 20 - 26.05.40	1 030 000	EUR	782 077	822 403	0,03
Richemont International Holdings SA 2.00% 18 - 26.03.38	1 690 000	EUR	1 399 713	1 462 053	0,06
Segro Capital Sarl 0.50% 21 - 22.09.31	670 000	EUR	552 984	526 372	0,02
Segro Capital Sarl 1.25% 22 - 23.03.26	870 000	EUR	837 609	831 911	0,03
Segro Capital Sarl 1.875% 22 - 23.03.30	480 000	EUR	446 524	440 544	0,02
SES SA 0.875% 19 - 04.11.27	800 000	EUR	749 180	724 040	0,03
SES SA 1.625% 18 - 22.03.26	895 000	EUR	884 715	852 658	0,04
SES SA 2.00% 20 - 02.07.28	480 000	EUR	444 630	451 949	0,02
SES SA 3.50% 22 - 14.01.29	1 150 000	EUR	1 094 008	1 133 164	0,05
Simon International Finance SCA 1.125% 21 - 19.03.33	890 000	EUR	680 730	719 040	0,03
Simon International Finance SCA 1.25% 16 - 13.05.25	500 000	EUR	483 491	482 505	0,02
Swiss Re Finance Luxembourg SA FRN 19 - 30.04.50	600 000	EUR	515 639	555 786	0,02
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 20 - 14.02.25	860 000	EUR	841 218	827 346	0,03
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 21 - 16.02.29	790 000	EUR	703 027	682 686	0,03
Whirlpool EMEA Finance Sarl 0.50% 20 - 20.02.28	750 000	EUR	693 013	664 500	0,03
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.10% 17 - 09.11.27	740 000	EUR	702 299	682 376	0,03
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.25% 16 - 02.11.26	810 000	EUR	772 298	765 458	0,03
			99 427 015	97 535 145	4,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
America Movil SAB de CV 0.75% 19 - 26.06.27	1 000 000	EUR	901 346	921 940	0,04
America Movil SAB de CV 2.125% 16 - 10.03.28	890 000	EUR	832 419	851 881	0,03
			1 733 765	1 773 821	0,07
Pays-Bas					
ABB Finance BV Zero Coupon 21 - 19.01.30	1 060 000	EUR	926 223	892 615	0,04
ABB Finance BV 3.25% 23 - 16.01.27	660 000	EUR	654 870	667 649	0,03
ABB Finance BV 3.375% 23 - 16.01.31	1 220 000	EUR	1 200 341	1 251 159	0,05
ABN AMRO Bank NV 0.50% 19 - 15.04.26	900 000	EUR	872 096	851 742	0,04
ABN AMRO Bank NV 0.50% 21 - 23.09.29	1 100 000	EUR	965 258	934 681	0,04
ABN AMRO Bank NV 0.60% 20 - 15.01.27	1 500 000	EUR	1 433 660	1 384 470	0,06
ABN AMRO Bank NV 0.875% 18 - 22.04.25	900 000	EUR	888 688	870 192	0,04
ABN AMRO Bank NV 1.00% 15 - 16.04.25	1 565 000	EUR	1 552 965	1 519 036	0,06
ABN AMRO Bank NV 1.00% 21 - 02.06.33	1 000 000	EUR	847 464	827 420	0,03
ABN AMRO Bank NV 1.25% 20 - 28.05.25	1 700 000	EUR	1 680 322	1 648 014	0,07
ABN AMRO Bank NV 1.25% 22 - 20.01.34	1 200 000	EUR	966 668	971 316	0,04
ABN AMRO Bank NV 2.375% 22 - 01.06.27	800 000	EUR	782 535	778 672	0,03
ABN AMRO Bank NV 3.00% 22 - 01.06.32	900 000	EUR	855 256	878 076	0,04
ABN AMRO Bank NV 3.625% 23 - 10.01.26	1 000 000	EUR	996 629	1 008 000	0,04
ABN AMRO Bank NV 3.75% 23 - 20.04.25	1 700 000	EUR	1 699 363	1 706 375	0,07
ABN AMRO Bank NV 3.875% 23 - 21.12.26	1 100 000	EUR	1 094 279	1 122 407	0,05
ABN AMRO Bank NV 4.00% 23 - 16.01.28	1 200 000	EUR	1 194 395	1 230 576	0,05
ABN AMRO Bank NV 4.25% 22 - 21.02.30	1 500 000	EUR	1 499 425	1 557 150	0,06
ABN AMRO Bank NV 4.375% 23 - 20.10.28	1 500 000	EUR	1 501 097	1 555 380	0,06
ABN AMRO Bank NV 4.50% 22 - 21.11.34	1 200 000	EUR	1 220 227	1 287 696	0,05
ABN AMRO Bank NV FRN 22 - 22.02.33	1 200 000	EUR	1 204 967	1 234 392	0,05
ABN AMRO Bank NV 5.50% 23 - 21.09.33	800 000	EUR	794 899	837 048	0,03
Achmea BV 1.50% 20 - 26.05.27	807 000	EUR	781 219	765 835	0,03
Achmea BV 3.625% 22 - 29.11.25	620 000	EUR	619 034	622 641	0,03
Achmea BV FRN 15 - 29.12.49	800 000	EUR	808 354	792 312	0,03
Achmea BV FRN 23 - 26.12.43	400 000	EUR	402 676	434 116	0,02
Adecco International Financial Services BV 0.125% 21 - 21.09.28	840 000	EUR	742 452	744 265	0,03
Adecco International Financial Services BV 0.50% 21 - 21.09.31	610 000	EUR	504 836	506 697	0,02
Adecco International Financial Services BV FRN 21 - 21.03.82	680 000	EUR	575 673	590 165	0,02
Adecco International Financial Services BV 1.25% 19 - 20.11.29	550 000	EUR	505 639	498 911	0,02
AGCO International Holdings BV 0.80% 21 - 06.10.28	860 000	EUR	759 603	753 136	0,03
Akzo Nobel NV 1.125% 16 - 08.04.26	650 000	EUR	635 543	623 636	0,03
Akzo Nobel NV 1.50% 22 - 28.03.28	930 000	EUR	888 582	873 586	0,04
Akzo Nobel NV 1.625% 20 - 14.04.30	879 000	EUR	838 336	794 264	0,03
Akzo Nobel NV 2.00% 22 - 28.03.32	940 000	EUR	853 880	843 528	0,04
Akzo Nobel NV 4.00% 23 - 24.05.33	830 000	EUR	821 977	860 154	0,04
Allianz Finance II BV Zero Coupon 20 - 14.01.25	400 000	EUR	387 326	386 596	0,02
Allianz Finance II BV Zero Coupon 21 - 22.11.26	700 000	EUR	655 717	649 530	0,03
Allianz Finance II BV 0.50% 20 - 14.01.31	900 000	EUR	812 123	776 313	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Allianz Finance II BV 0.50% 21 - 22.11.33	500 000	EUR	389 836	401 885	0,02
Allianz Finance II BV 0.875% 17 - 06.12.27	800 000	EUR	777 552	750 760	0,03
Allianz Finance II BV 0.875% 19 - 15.01.26	1 000 000	EUR	974 725	961 190	0,04
Allianz Finance II BV 1.375% 16 - 21.04.31	700 000	EUR	678 774	641 487	0,03
Allianz Finance II BV 1.50% 19 - 15.01.30	900 000	EUR	865 613	840 393	0,04
Allianz Finance II BV 3.00% 13 - 13.03.28	800 000	EUR	853 385	812 968	0,03
American Medical Systems Europe BV 0.75% 22 - 08.03.25	1 300 000	EUR	1 263 728	1 256 749	0,05
American Medical Systems Europe BV 1.375% 22 - 08.03.28	1 000 000	EUR	927 831	935 920	0,04
American Medical Systems Europe BV 1.625% 22 - 08.03.31	1 220 000	EUR	1 074 388	1 102 453	0,05
American Medical Systems Europe BV 1.875% 22 - 08.03.34	700 000	EUR	583 806	608 944	0,03
Arcadis NV 4.875% 23 - 28.02.28	720 000	EUR	724 085	745 711	0,03
ASML Holding NV 3.50% 23 - 06.12.25	1 440 000	EUR	1 434 523	1 451 462	0,06
ASML Holdings NV 0.25% 20 - 25.02.30	1 180 000	EUR	1 033 468	1 013 219	0,04
ASML Holdings NV 0.625% 20 - 07.05.29	1 080 000	EUR	995 943	966 470	0,04
ASML Holdings NV 1.375% 16 - 07.07.26	1 360 000	EUR	1 355 283	1 311 122	0,05
ASML Holdings NV 1.625% 16 - 28.05.27	1 270 000	EUR	1 252 056	1 220 140	0,05
ASML Holdings NV 2.25% 22 - 17.05.32	680 000	EUR	665 809	657 553	0,03
ASR Nederland NV FRN 19 - 02.05.49	600 000	EUR	561 861	556 434	0,02
ASR Nederland NV 3.625% 23 - 12.12.28	700 000	EUR	707 451	710 304	0,03
ASR Nederland NV FRN 15 - 29.09.45	616 000	EUR	626 227	622 480	0,03
ASR Nederland NV FRN 22 - 07.12.43	1 200 000	EUR	1 242 585	1 352 400	0,06
Athora Netherlands NV FRN 21 - 15.07.31	370 000	EUR	324 929	329 526	0,01
Athora Netherlands NV FRN 22 - 31.08.32	580 000	EUR	558 905	556 017	0,02
BMW Finance NV Zero Coupon 21 - 11.01.26	1 450 000	EUR	1 395 786	1 368 785	0,06
BMW Finance NV 0.20% 21 - 11.01.33	623 000	EUR	505 430	490 718	0,02
BMW Finance NV 0.375% 19 - 24.09.27	1 073 000	EUR	1 030 515	989 167	0,04
BMW Finance NV 0.375% 20 - 14.01.27	1 176 000	EUR	1 131 369	1 097 396	0,05
BMW Finance NV 0.50% 22 - 22.02.25	1 830 000	EUR	1 794 004	1 768 695	0,07
BMW Finance NV 0.75% 19 - 13.07.26	1 171 000	EUR	1 145 320	1 109 651	0,05
BMW Finance NV 0.875% 17 - 03.04.25	1 120 000	EUR	1 111 355	1 086 646	0,05
BMW Finance NV 0.875% 20 - 14.01.32	560 000	EUR	493 444	487 850	0,02
BMW Finance NV 1.00% 15 - 21.01.25	1 020 000	EUR	1 016 423	993 133	0,04
BMW Finance NV 1.00% 18 - 29.08.25	1 181 000	EUR	1 159 518	1 141 543	0,05
BMW Finance NV 1.00% 22 - 22.05.28	1 020 000	EUR	950 023	945 999	0,04
BMW Finance NV 1.125% 18 - 10.01.28	1 080 000	EUR	1 040 647	1 011 334	0,04
BMW Finance NV 1.125% 18 - 22.05.26	1 080 000	EUR	1 070 964	1 035 342	0,04
BMW Finance NV 1.50% 19 - 06.02.29	2 402 000	EUR	2 365 538	2 246 302	0,09
BMW Finance NV 3.25% 23 - 22.11.26	1 000 000	EUR	995 788	1 008 670	0,04
BMW Finance NV 3.25% 23 - 22.07.30	630 000	EUR	624 843	644 055	0,03
BMW Finance NV 3.50% 23 - 06.04.25	600 000	EUR	600 392	601 152	0,03
BMW Finance NV 3.625% 23 - 22.05.35	1 140 000	EUR	1 140 293	1 185 566	0,05
BMW Finance NV 3.875% 23 - 04.10.28	800 000	EUR	804 663	836 496	0,03
BMW Finance NV 4.125% 23 - 04.10.33	780 000	EUR	776 282	840 005	0,04
Brenntag Finance BV 0.50% 21 - 06.10.29	700 000	EUR	608 090	599 144	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Brenntag Finance BV 1.125% 17 - 27.09.25	940 000	EUR	908 899	905 380	0,04
Coca-Cola HBC Finance BV 0.625% 19 - 21.11.29	850 000	EUR	761 788	735 480	0,03
Coca-Cola HBC Finance BV 1.00% 19 - 14.05.27	910 000	EUR	863 352	852 643	0,04
Coca-Cola HBC Finance BV 1.625% 19 - 14.05.31	800 000	EUR	725 022	719 360	0,03
Coca-Cola HBC Finance BV 2.75% 22 - 23.09.25	810 000	EUR	801 163	802 499	0,03
Coloplast Finance BV 2.25% 22 - 19.05.27	1 210 000	EUR	1 169 853	1 174 244	0,05
Coloplast Finance BV 2.75% 22 - 19.05.30	970 000	EUR	949 308	938 174	0,04
Compass Group Finance Netherlands BV 1.50% 18 - 05.09.28	910 000	EUR	875 043	858 621	0,04
Compass Group Finance Netherlands BV 3.00% 22 - 08.03.30	600 000	EUR	577 520	597 198	0,02
Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 19 - 30.10.26	900 000	EUR	852 737	838 647	0,03
Cooperatieve Rabobank UA FRN 21 - 01.12.27	1 100 000	EUR	1 027 296	1 009 008	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 0.625% 21 - 25.02.33	1 000 000	EUR	847 143	796 710	0,03
Cooperatieve Rabobank UA FRN 20 - 05.05.28	1 200 000	EUR	1 160 316	1 106 124	0,05
Cooperatieve Rabobank UA 1.125% 19 - 07.05.31	1 100 000	EUR	995 584	944 790	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 1.25% 16 - 23.03.26	2 385 000	EUR	2 371 444	2 299 188	0,10
Cooperatieve Rabobank UA 1.375% 15 - 03.02.27	1 690 000	EUR	1 698 089	1 606 852	0,07
Cooperatieve Rabobank UA FRN 22 - 30.11.32	800 000	EUR	775 787	799 832	0,03
Cooperatieve Rabobank UA 3.913% 23 - 03.11.26	1 300 000	EUR	1 302 859	1 329 419	0,06
Cooperatieve Rabobank UA 4.00% 23 - 10.01.30	1 500 000	EUR	1 501 753	1 548 825	0,06
Cooperatieve Rabobank UA 4.125% 10 - 14.07.25	3 197 000	EUR	3 329 636	3 233 765	0,13
Cooperatieve Rabobank UA FRN 23 - 25.04.29	1 600 000	EUR	1 600 409	1 646 560	0,07
Cooperatieve Rabobank UA FRN 22 - 27.01.28	1 200 000	EUR	1 214 019	1 242 552	0,05
CRH Funding BV 1.625% 20 - 05.05.30	1 176 000	EUR	1 097 662	1 071 418	0,04
CTP NV 0.50% 21 - 21.06.25	600 000	EUR	556 025	565 020	0,02
CTP NV 0.625% 21 - 27.09.26	600 000	EUR	522 340	539 766	0,02
CTP NV 0.75% 21 - 18.02.27	600 000	EUR	509 091	534 228	0,02
CTP NV 0.875% 22 - 20.01.26	800 000	EUR	720 237	741 776	0,03
CTP NV 1.25% 21 - 21.06.29	500 000	EUR	386 759	412 930	0,02
CTP NV 1.50% 21 - 27.09.31	600 000	EUR	424 173	466 770	0,02
CTP NV 2.125% 20 - 01.10.25	500 000	EUR	467 976	480 155	0,02
Daimler Truck International Finance BV 1.25% 22 - 06.04.25	900 000	EUR	880 693	875 043	0,04
Daimler Truck International Finance BV 1.625% 22 - 06.04.27	800 000	EUR	768 606	765 520	0,03
Daimler Truck International Finance BV 3.875% 23 - 19.06.26	1 100 000	EUR	1 096 239	1 118 546	0,05
Daimler Truck International Finance BV 3.875% 23 - 19.06.29	700 000	EUR	692 667	722 883	0,03
Deutsche Telekom International Finance BV 1.125% 17 - 22.05.26	830 000	EUR	817 333	800 983	0,03
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 17 - 30.01.27	1 330 000	EUR	1 300 729	1 278 728	0,05
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 18 - 01.12.25	1 050 000	EUR	1 039 698	1 021 261	0,04
Deutsche Telekom International Finance BV 1.50% 16 - 03.04.28	2 254 000	EUR	2 223 661	2 138 528	0,09

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.00% 18 - 01.12.29	1 351 000	EUR	1 373 900	1 307 565	0,05
Deutsche Telekom International Finance BV 3.25% 13 - 17.01.28	1 280 000	EUR	1 358 669	1 316 160	0,05
Deutsche Telekom International Finance BV 4.50% 10 - 28.10.30	490 000	EUR	539 464	539 485	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 4.875% 10 - 22.04.25	492 000	EUR	512 581	506 494	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 7.50% 03 - 24.01.33	750 000	EUR	1 037 022	1 007 265	0,04
Digital Dutch Finco BV 0.625% 20 - 15.07.25	770 000	EUR	741 736	729 452	0,03
Digital Dutch Finco BV 1.00% 20 - 15.01.32	950 000	EUR	802 352	756 666	0,03
Digital Dutch Finco BV 1.25% 20 - 01.02.31	560 000	EUR	466 342	468 474	0,02
Digital Dutch Finco BV 1.50% 20 - 15.03.30	800 000	EUR	730 716	696 240	0,03
Digital Intrepid Holdings BV 0.625% 21 - 15.07.31	1 290 000	EUR	1 051 687	1 012 044	0,04
Digital Intrepid Holdings BV 1.375% 22 - 18.07.32	920 000	EUR	753 878	748 954	0,03
DSM BV 0.25% 20 - 23.06.28	500 000	EUR	432 560	450 065	0,02
DSM BV 0.625% 20 - 23.06.32	650 000	EUR	505 696	536 738	0,02
DSM BV 0.75% 16 - 28.09.26	1 400 000	EUR	1 304 950	1 330 392	0,06
DSM BV 1.00% 15 - 09.04.25	600 000	EUR	579 068	583 158	0,02
DSV Finance BV 0.50% 21 - 03.03.31	678 000	EUR	582 709	566 910	0,02
DSV Finance BV 0.75% 21 - 05.07.33	920 000	EUR	755 311	734 123	0,03
DSV Finance BV 0.875% 21 - 17.09.36	610 000	EUR	464 980	452 248	0,02
DSV Finance BV 1.375% 22 - 16.03.30	940 000	EUR	851 860	850 606	0,04
easyJet FinCo BV 1.875% 21 - 03.03.28	1 662 000	EUR	1 499 533	1 553 438	0,06
Essity Capital BV 0.25% 21 - 15.09.29	1 040 000	EUR	925 030	904 415	0,04
Essity Capital BV 3.00% 22 - 21.09.26	750 000	EUR	742 345	747 960	0,03
Euronext NV 0.125% 21 - 17.05.26	790 000	EUR	733 940	734 574	0,03
Euronext NV 0.75% 21 - 17.05.31	770 000	EUR	691 711	641 949	0,03
Euronext NV 1.00% 18 - 18.04.25	430 000	EUR	423 833	415 483	0,02
Euronext NV 1.125% 19 - 12.06.29	990 000	EUR	939 839	903 939	0,04
Euronext NV 1.50% 21 - 17.05.41	710 000	EUR	575 260	533 338	0,02
EXOR NV 0.875% 21 - 19.01.31	560 000	EUR	510 895	482 362	0,02
EXOR NV 1.75% 18 - 18.01.28	470 000	EUR	476 388	449 767	0,02
EXOR NV 1.75% 19 - 14.10.34	630 000	EUR	747 245	527 367	0,02
EXOR NV 2.25% 20 - 29.04.30	570 000	EUR	573 384	537 128	0,02
Ferrovial SE 4.375% 23 - 13.09.30	870 000	EUR	863 444	917 633	0,04
Givaudan Finance Europe BV 1.00% 20 - 22.04.27	650 000	EUR	624 562	616 649	0,03
Givaudan Finance Europe BV 1.625% 20 - 22.04.32	739 000	EUR	685 797	660 237	0,03
Givaudan Finance Europe BV 4.125% 23 - 28.11.33	700 000	EUR	711 052	745 955	0,03
GSK Capital BV 3.00% 22 - 28.11.27	900 000	EUR	898 266	907 218	0,04
GSK Capital BV 3.125% 22 - 28.11.32	1 050 000	EUR	1 022 130	1 061 980	0,04
H&M Finance BV 0.25% 21 - 25.08.29	825 000	EUR	718 562	689 321	0,03
H&M Finance BV 4.875% 23 - 25.10.31	742 000	EUR	754 834	792 701	0,03
Haleon Netherlands Capital BV 1.25% 22 - 29.03.26	1 200 000	EUR	1 132 186	1 151 220	0,05
Haleon Netherlands Capital BV 1.75% 22 - 29.03.30	1 040 000	EUR	918 752	958 266	0,04
Haleon Netherlands Capital BV 2.125% 22 - 29.03.34	1 140 000	EUR	957 418	1 012 012	0,04
IMCD NV 2.125% 22 - 31.03.27	450 000	EUR	428 088	430 038	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
IMCD NV 4.875% 23 - 18.09.28	680 000	EUR	673 473	712 756	0,03
ING Bank NV 4.125% 23 - 02.10.26	1 200 000	EUR	1 202 410	1 229 352	0,05
ING Groep NV FRN 20 - 18.02.29	1 400 000	EUR	1 345 347	1 214 836	0,05
ING Groep NV FRN 21 - 01.02.30	1 900 000	EUR	1 694 504	1 602 251	0,07
ING Groep NV FRN 21 - 29.09.28	1 800 000	EUR	1 684 346	1 597 806	0,07
ING Groep NV FRN 21 - 09.06.32	600 000	EUR	538 958	538 866	0,02
ING Groep NV FRN 21 - 29.11.30	900 000	EUR	785 957	768 528	0,03
ING Groep NV FRN 19 - 13.11.30	1 300 000	EUR	1 210 105	1 217 905	0,05
ING Groep NV FRN 21 - 16.11.32	1 000 000	EUR	889 854	884 290	0,04
ING Groep NV 1.125% 18 - 14.02.25	1 200 000	EUR	1 182 033	1 168 608	0,05
ING Groep NV FRN 22 - 16.02.27	1 600 000	EUR	1 542 534	1 521 712	0,06
ING Groep NV 1.375% 17 - 11.01.28	1 200 000	EUR	1 134 807	1 128 900	0,05
ING Groep NV FRN 22 - 16.02.31	1 900 000	EUR	1 742 620	1 698 182	0,07
ING Groep NV FRN 18 - 22.03.30	900 000	EUR	860 000	870 345	0,04
ING Groep NV 2.00% 18 - 20.09.28	1 800 000	EUR	1 758 360	1 711 008	0,07
ING Groep NV 2.125% 19 - 10.01.26	1 100 000	EUR	1 089 951	1 077 417	0,04
ING Groep NV FRN 20 - 26.05.31	1 700 000	EUR	1 650 278	1 621 766	0,07
ING Groep NV FRN 22 - 23.05.26	1 600 000	EUR	1 574 633	1 565 408	0,07
ING Groep NV 2.50% 18 - 15.11.30	1 700 000	EUR	1 679 875	1 627 563	0,07
ING Groep NV FRN 22 - 24.08.33	1 100 000	EUR	1 057 710	1 103 685	0,05
ING Groep NV FRN 23 - 23.05.29	1 700 000	EUR	1 702 206	1 752 071	0,07
ING Groep NV FRN 23 - 23.05.34	1 600 000	EUR	1 608 718	1 702 224	0,07
ING Groep NV FRN 22 - 14.11.27	1 600 000	EUR	1 625 513	1 659 424	0,07
ING Groep NV FRN 23 - 20.02.35	600 000	EUR	584 612	619 122	0,03
ING Groep NV FRN 22 - 14.11.33	1 200 000	EUR	1 260 699	1 317 372	0,05
ISS Finance BV 1.25% 20 - 07.07.25	790 000	EUR	776 421	760 091	0,03
JDE Peet's NV Zero Coupon 21 - 16.01.26	1 140 000	EUR	1 079 962	1 065 626	0,04
JDE Peet's NV 0.244% 21 - 16.01.25	650 000	EUR	632 140	625 671	0,03
JDE Peet's NV 0.50% 21 - 16.01.29	980 000	EUR	852 674	848 964	0,04
JDE Peet's NV 0.625% 21 - 09.02.28	940 000	EUR	854 586	842 231	0,04
JDE Peet's NV 1.125% 21 - 16.06.33	700 000	EUR	565 240	560 721	0,02
JDE Peet's NV 4.125% 23 - 23.01.30	800 000	EUR	800 703	822 032	0,03
JDE Peet's NV 4.50% 23 - 23.01.34	800 000	EUR	803 868	840 328	0,04
Koninklijke Ahold Delhaize NV 0.25% 19 - 26.06.25	740 000	EUR	720 457	710 156	0,03
Koninklijke Ahold Delhaize NV 0.375% 21 - 18.03.30	970 000	EUR	868 276	821 299	0,03
Koninklijke Ahold Delhaize NV 1.125% 18 - 19.03.26	880 000	EUR	863 268	847 880	0,04
Koninklijke Ahold Delhaize NV 1.75% 20 - 02.04.27	750 000	EUR	738 846	724 658	0,03
Koninklijke Ahold Delhaize NV 3.50% 23 - 04.04.28	700 000	EUR	703 061	714 539	0,03
Koninklijke KPN NV 0.625% 16 - 09.04.25	800 000	EUR	783 456	771 424	0,03
Koninklijke KPN NV 0.875% 20 - 14.12.32	900 000	EUR	766 734	733 257	0,03
Koninklijke KPN NV 0.875% 21 - 15.11.33	1 100 000	EUR	895 366	876 700	0,04
Koninklijke KPN NV 1.125% 16 - 11.09.28	900 000	EUR	846 669	830 538	0,03
Koninklijke KPN NV 3.875% 23 - 03.07.31	800 000	EUR	794 028	829 512	0,03
LeasePlan Corp. NV 0.25% 21 - 23.02.26	969 000	EUR	921 901	902 885	0,04
LeasePlan Corp. NV 0.25% 21 - 07.09.26	1 220 000	EUR	1 158 024	1 120 716	0,05
LeasePlan Corp. NV 2.125% 22 - 06.05.25	910 000	EUR	896 056	893 638	0,04
LeasePlan Corp. NV 3.50% 20 - 09.04.25	673 000	EUR	679 173	672 482	0,03
Linde Finance BV 0.25% 20 - 19.05.27	1 100 000	EUR	1 045 498	1 010 229	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Linde Finance BV 0.55% 20 - 19.05.32	1 200 000	EUR	1 057 689	993 840	0,04
Linde Finance BV 1.00% 16 - 20.04.28	1 175 000	EUR	1 155 632	1 105 510	0,05
Lseg Netherlands BV Zero Coupon 21 - 06.04.25	640 000	EUR	620 804	613 453	0,03
Lseg Netherlands BV 0.25% 21 - 06.04.28	620 000	EUR	575 413	552 711	0,02
Lseg Netherlands BV 0.75% 21 - 06.04.33	560 000	EUR	473 352	450 234	0,02
Lseg Netherlands BV 4.125% 23 - 29.09.26	970 000	EUR	973 223	994 987	0,04
Lseg Netherlands BV 4.231% 23 - 29.09.30	870 000	EUR	873 833	918 381	0,04
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.375% 19 - 26.02.25	500 000	EUR	485 498	481 715	0,02
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.50% 21 - 21.09.28	600 000	EUR	534 723	529 260	0,02
NE Property BV 1.875% 19 - 09.10.26	400 000	EUR	356 558	365 396	0,02
NE Property BV 2.00% 22 - 20.01.30	580 000	EUR	440 582	467 225	0,02
NE Property BV 3.375% 20 - 14.07.27	650 000	EUR	595 913	612 261	0,03
NIBC Bank NV 0.25% 21 - 09.09.26	900 000	EUR	821 835	823 077	0,03
NIBC Bank NV 0.875% 19 - 08.07.25	500 000	EUR	484 743	478 130	0,02
NIBC Bank NV 0.875% 22 - 24.06.27	500 000	EUR	456 882	455 385	0,02
NIBC Bank NV 6.00% 23 - 16.11.28	600 000	EUR	617 562	637 584	0,03
NIBC Bank NV 6.375% 23 - 01.12.25	500 000	EUR	503 379	523 785	0,02
NN Group NV 0.875% 21 - 23.11.31	650 000	EUR	538 074	557 278	0,02
NN Group NV 1.625% 17 - 01.06.27	810 000	EUR	794 571	779 163	0,03
NN Group NV FRN 14 - 15.07.49	1 240 000	EUR	1 285 984	1 235 102	0,05
NN Group NV FRN 17 - 13.01.48	840 000	EUR	850 304	841 764	0,04
NN Group NV FRN 22 - 01.03.43	590 000	EUR	573 341	602 579	0,03
NN Group NV FRN 23 - 03.11.43	1 180 000	EUR	1 177 994	1 257 786	0,05
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.125% 21 - 04.06.28	900 000	EUR	837 548	808 137	0,03
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.75% 22 - 31.03.25	680 000	EUR	668 573	659 267	0,03
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 1.125% 22 - 30.09.27	850 000	EUR	809 065	805 554	0,03
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 1.375% 22 - 31.03.30	710 000	EUR	673 178	659 902	0,03
OCI NV 3.625% 20 - 15.10.25	378 000	EUR	376 889	374 303	0,02
PACCAR Financial Europe BV Zero Coupon 21 - 01.03.26	570 000	EUR	532 740	532 637	0,02
PACCAR Financial Europe BV 3.25% 22 - 29.11.25	790 000	EUR	785 453	791 074	0,03
PACCAR Financial Europe BV 3.375% 23 - 15.05.26	660 000	EUR	656 957	666 428	0,03
PostNL NV 0.625% 19 - 23.09.26	380 000	EUR	357 525	351 812	0,01
Prosus NV Zero Coupon 21 - 13.07.29	1 330 000	EUR	1 130 442	1 080 519	0,05
Prosus NV 1.207% 22 - 19.01.26	680 000	EUR	638 384	639 112	0,03
Prosus NV 1.539% 20 - 03.08.28	1 180 000	EUR	1 066 682	1 017 915	0,04
Prosus NV 1.985% 21 - 13.07.33	1 300 000	EUR	1 039 430	960 362	0,04
Prosus NV 2.031% 20 - 03.08.32	1 120 000	EUR	906 057	858 592	0,04
Prosus NV 2.085% 22 - 19.01.30	900 000	EUR	796 549	753 345	0,03
Prosus NV 2.778% 22 - 19.01.34	1 000 000	EUR	840 799	779 630	0,03
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.375% 20 - 19.05.26	1 300 000	EUR	1 251 433	1 226 004	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.75% 20 - 19.05.30	1 140 000	EUR	1 035 888	998 640	0,04
RELX Finance BV 0.50% 20 - 10.03.28	1 381 000	EUR	1 285 281	1 252 387	0,05
RELX Finance BV 0.875% 20 - 10.03.32	638 000	EUR	536 714	538 338	0,02
RELX Finance BV 1.375% 16 - 12.05.26	890 000	EUR	888 273	859 829	0,04
RELX Finance BV 1.50% 18 - 13.05.27	750 000	EUR	720 588	717 990	0,03
RELX Finance BV 3.75% 23 - 12.06.31	1 170 000	EUR	1 167 654	1 216 870	0,05
Rentokil Initial Finance BV 3.875% 22 - 27.06.27	1 340 000	EUR	1 371 424	1 365 795	0,06
Rentokil Initial Finance BV 4.375% 22 - 27.06.30	890 000	EUR	939 820	940 632	0,04
Robert Bosch Investment Nederland BV 2.625% 13 - 24.05.28	1 100 000	EUR	1 073 067	1 087 911	0,05
Roche Finance Europe BV 0.875% 15 - 25.02.25	1 526 000	EUR	1 511 156	1 489 956	0,06
Roche Finance Europe BV 3.204% 23 - 27.08.29	1 150 000	EUR	1 139 849	1 180 348	0,05
Roche Finance Europe BV 3.312% 23 - 04.12.27	860 000	EUR	860 000	880 244	0,04
Roche Finance Europe BV 3.355% 23 - 27.02.35	670 000	EUR	662 366	699 212	0,03
Roche Finance Europe BV 3.586% 23 - 04.12.36	1 300 000	EUR	1 306 179	1 374 945	0,06
Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 21 - 26.01.28	560 000	EUR	495 010	478 458	0,02
Sagax Euro Mtn NL BV 1.00% 21 - 17.05.29	640 000	EUR	569 919	523 213	0,02
Sagax Euro Mtn NL BV 1.625% 22 - 24.02.26	410 000	EUR	392 536	388 619	0,02
Sandoz Finance BV 3.97% 23 - 17.04.27	1 000 000	EUR	1 022 950	1 019 910	0,04
Sandoz Finance BV 4.22% 23 - 17.04.30	1 000 000	EUR	1 043 590	1 036 640	0,04
Sandoz Finance BV 4.50% 23 - 17.11.33	900 000	EUR	964 332	954 423	0,04
Sartorius Finance BV 4.25% 23 - 14.09.26	1 000 000	EUR	1 001 576	1 022 340	0,04
Sartorius Finance BV 4.375% 23 - 14.09.29	900 000	EUR	897 225	932 535	0,04
Sartorius Finance BV 4.50% 23 - 14.09.32	1 300 000	EUR	1 287 058	1 353 846	0,06
Sartorius Finance BV 4.875% 23 - 14.09.35	1 200 000	EUR	1 185 368	1 265 280	0,05
SGS Nederland Holdings BV 0.125% 21 - 21.04.27	1 100 000	EUR	1 024 201	998 580	0,04
Siemens Energy Finance BV 4.00% 23 - 05.04.26	1 100 000	EUR	1 103 534	1 085 480	0,05
Siemens Energy Finance BV 4.25% 23 - 05.04.29	1 100 000	EUR	1 100 616	1 071 169	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 20 - 20.02.26	1 600 000	EUR	1 546 757	1 507 376	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.125% 19 - 05.09.29	1 250 000	EUR	1 163 911	1 114 950	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.25% 20 - 20.02.29	1 500 000	EUR	1 384 239	1 324 770	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.375% 20 - 05.06.26	1 300 000	EUR	1 254 395	1 226 368	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.50% 19 - 05.09.34	1 460 000	EUR	1 214 286	1 135 442	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.50% 20 - 20.02.32	1 200 000	EUR	1 102 090	993 696	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.625% 22 - 25.02.27	800 000	EUR	757 451	748 344	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.90% 19 - 28.02.28	1 110 000	EUR	1 074 786	1 037 539	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.00% 18 - 06.09.27	1 018 000	EUR	987 463	968 993	0,04

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.00% 22 - 25.02.30	1 200 000	EUR	1 096 387	1 081 440	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.25% 19 - 28.02.31	1 060 000	EUR	989 607	957 827	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.25% 22 - 25.02.35	1 100 000	EUR	1 002 345	917 884	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.375% 18 - 06.09.30	1 343 000	EUR	1 336 040	1 232 458	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.75% 19 - 28.02.39	1 102 000	EUR	999 302	913 448	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.25% 22 - 10.03.25	1 400 000	EUR	1 388 352	1 381 506	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.50% 22 - 08.09.27	600 000	EUR	588 280	596 724	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.75% 22 - 09.09.30	900 000	EUR	878 154	896 103	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.875% 13 - 10.03.28	1 500 000	EUR	1 586 552	1 517 040	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.00% 22 - 08.09.33	1 500 000	EUR	1 455 632	1 500 090	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.375% 23 - 24.08.31	1 900 000	EUR	1 871 960	1 958 843	0,08
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.50% 23 - 24.02.36	800 000	EUR	773 089	827 560	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.625% 23 - 24.02.43	1 000 000	EUR	963 557	1 040 570	0,04
Signify NV 2.375% 20 - 11.05.27	940 000	EUR	911 231	911 565	0,04
Sika Capital BV 0.875% 19 - 29.04.27	780 000	EUR	743 540	728 918	0,03
Sika Capital BV 1.50% 19 - 29.04.31	670 000	EUR	601 325	603 114	0,03
Sika Capital BV 3.75% 23 - 03.11.26	1 200 000	EUR	1 196 496	1 219 872	0,05
Sika Capital BV 3.75% 23 - 03.05.30	1 290 000	EUR	1 292 897	1 327 642	0,06
Sudzucker International Finance BV 1.00% 17 - 28.11.25	722 000	EUR	698 745	687 474	0,03
Sudzucker International Finance BV 5.125% 22 - 31.10.27	600 000	EUR	609 056	633 246	0,03
Telefonica Europe BV 5.875% 03 - 14.02.33	750 000	EUR	925 691	900 488	0,04
Thermo Fisher Scientific Finance I BV Zero Coupon 21 - 18.11.25	850 000	EUR	814 668	802 009	0,03
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 0.80% 21 - 18.10.30	2 535 000	EUR	2 291 969	2 200 152	0,09
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.125% 21 - 18.10.33	2 140 000	EUR	1 901 839	1 777 056	0,07
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 21 - 18.10.41	1 780 000	EUR	1 511 965	1 340 999	0,06
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 2.00% 21 - 18.10.51	1 100 000	EUR	941 089	787 270	0,03
Universal Music Group NV 3.00% 22 - 30.06.27	850 000	EUR	837 518	850 408	0,04
Universal Music Group NV 3.75% 22 - 30.06.32	700 000	EUR	709 793	721 007	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Universal Music Group NV 4.00% 23 - 13.06.31	1 000 000	EUR	994 147	1 045 070	0,04
Vestas Wind Systems Finance BV 1.50% 22 - 15.06.29	730 000	EUR	694 397	668 775	0,03
Vestas Wind Systems Finance BV 2.00% 22 - 15.06.34	700 000	EUR	641 809	612 507	0,03
Vonovia Finance BV 0.50% 19 - 14.09.29	600 000	EUR	535 778	494 226	0,02
Vonovia Finance BV 0.625% 19 - 07.10.27	600 000	EUR	540 748	537 042	0,02
Vonovia Finance BV 0.625% 20 - 09.07.26	800 000	EUR	780 844	746 088	0,03
Vonovia Finance BV 1.00% 20 - 09.07.30	800 000	EUR	630 535	663 128	0,03
Vonovia Finance BV 1.00% 21 - 28.01.41	600 000	EUR	482 262	357 816	0,01
Vonovia Finance BV 1.125% 17 - 08.09.25	400 000	EUR	390 148	382 900	0,02
Vonovia Finance BV 1.125% 19 - 14.09.34	600 000	EUR	480 885	447 438	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 15 - 31.03.25	621 000	EUR	616 487	603 755	0,03
Vonovia Finance BV 1.50% 16 - 10.06.26	500 000	EUR	487 123	476 935	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 14.01.28	600 000	EUR	553 273	549 522	0,02
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 22.03.26	700 000	EUR	691 483	669 466	0,03
Vonovia Finance BV 1.625% 19 - 07.10.39	600 000	EUR	480 074	413 436	0,02
Vonovia Finance BV 1.75% 17 - 25.01.27	500 000	EUR	482 914	475 145	0,02
Vonovia Finance BV 1.80% 19 - 29.06.25	600 000	EUR	600 490	580 422	0,02
Vonovia Finance BV 2.125% 18 - 22.03.30	600 000	EUR	581 828	537 024	0,02
Vonovia Finance BV 2.25% 20 - 07.04.30	500 000	EUR	486 977	449 595	0,02
Vonovia Finance BV 2.75% 18 - 22.03.38	600 000	EUR	504 499	505 020	0,02
Wabtec Transportation Netherlands BV 1.25% 21 - 03.12.27	810 000	EUR	714 961	746 366	0,03
Wolters Kluwer NV 0.25% 21 - 30.03.28	890 000	EUR	808 168	798 722	0,03
Wolters Kluwer NV 0.75% 20 - 03.07.30	760 000	EUR	694 361	659 870	0,03
Wolters Kluwer NV 1.50% 17 - 22.03.27	710 000	EUR	698 967	678 568	0,03
Wolters Kluwer NV 3.00% 22 - 23.09.26	850 000	EUR	839 215	851 513	0,04
Wolters Kluwer NV 3.75% 23 - 03.04.31	850 000	EUR	853 538	881 518	0,04
WPC Eurobond BV 0.95% 21 - 01.06.30	610 000	EUR	505 142	506 520	0,02
WPC Eurobond BV 1.35% 19 - 15.04.28	530 000	EUR	475 582	484 971	0,02
WPC Eurobond BV 2.125% 18 - 15.04.27	474 000	EUR	460 091	450 020	0,02
WPC Eurobond BV 2.25% 18 - 09.04.26	674 000	EUR	664 443	652 304	0,03
			318 372 234	315 318 038	13,17
Nouvelle-Zélande					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.20% 21 - 23.09.27	890 000	EUR	824 843	795 963	0,03
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.375% 19 - 17.09.29	350 000	EUR	313 060	299 946	0,01
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 1.125% 18 - 20.03.25	670 000	EUR	656 933	650 369	0,03
ASB Bank Ltd. 0.25% 21 - 08.09.28	1 080 000	EUR	963 355	941 425	0,04
ASB Bank Ltd. 0.50% 19 - 24.09.29	500 000	EUR	437 242	430 935	0,02
ASB Bank Ltd. 4.50% 23 - 16.03.27	660 000	EUR	664 182	681 318	0,03
Chorus Ltd. 0.875% 19 - 05.12.26	450 000	EUR	418 787	419 913	0,02
Chorus Ltd. 3.625% 22 - 07.09.29	770 000	EUR	753 439	782 643	0,03
Westpac Securities NZ Ltd. 0.10% 21 - 13.07.27	887 000	EUR	835 309	793 546	0,03
Westpac Securities NZ Ltd. 0.427% 21 - 14.12.26	770 000	EUR	716 289	707 707	0,03
Westpac Securities NZ Ltd. 1.099% 22 - 24.03.26	700 000	EUR	678 761	664 111	0,03
			7 262 200	7 167 876	0,30
Norvège					
DNB Bank ASA FRN 21 - 23.02.29	1 140 000	EUR	1 021 666	999 951	0,04
DNB Bank ASA FRN 22 - 18.01.28	1 020 000	EUR	952 562	934 626	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
DNB Bank ASA FRN 22 - 31.05.26	800 000	EUR	787 558	779 024	0,03
DNB Bank ASA FRN 22 - 21.09.27	1 440 000	EUR	1 422 637	1 435 421	0,06
DNB Bank ASA FRN 23 - 16.02.27	1 300 000	EUR	1 284 361	1 304 095	0,05
DNB Bank ASA FRN 23 - 14.03.29	1 140 000	EUR	1 153 516	1 174 964	0,05
DNB Bank ASA FRN 23 - 19.07.28	1 190 000	EUR	1 202 750	1 229 782	0,05
DNB Bank ASA FRN 22 - 28.02.33	1 000 000	EUR	1 000 719	1 023 930	0,04
DNB Bank ASA FRN 23 - 01.11.29	882 000	EUR	890 405	927 017	0,04
DNB Bank ASA FRN 23 - 13.09.33	550 000	EUR	551 004	572 550	0,02
Norsk Hydro ASA 1.125% 19 - 11.04.25	680 000	EUR	670 199	657 097	0,03
Norsk Hydro ASA 2.00% 19 - 11.04.29	470 000	EUR	425 057	433 387	0,02
Santander Consumer Bank AS 0.125% 20 - 25.02.25	700 000	EUR	676 916	671 769	0,03
Santander Consumer Bank AS 0.125% 21 - 14.04.26	600 000	EUR	555 764	555 948	0,02
Santander Consumer Bank AS 0.50% 22 - 11.08.25	500 000	EUR	490 215	475 340	0,02
Sparebank 1 Oestlandet 0.125% 21 - 03.03.28	431 000	EUR	393 792	378 741	0,02
Sparebank 1 Oestlandet 1.75% 22 - 27.04.27	700 000	EUR	663 901	665 714	0,03
SpareBank 1 SMN 0.01% 21 - 18.02.28	430 000	EUR	383 234	377 652	0,02
SpareBank 1 SMN 0.125% 19 - 11.09.26	650 000	EUR	598 107	598 208	0,03
SpareBank 1 SMN 3.125% 22 - 22.12.25	600 000	EUR	590 056	596 280	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.25% 21 - 09.11.26	430 000	EUR	416 471	395 127	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA FRN 21 - 15.07.27	539 000	EUR	505 635	493 940	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA 2.875% 22 - 20.09.25	700 000	EUR	688 514	693 630	0,03
SpareBank 1 SR-Bank ASA 3.75% 23 - 23.11.27	1 050 000	EUR	1 045 758	1 068 469	0,04
SpareBank 1 SR-Bank ASA 4.875% 23 - 24.08.28	700 000	EUR	706 111	736 904	0,03
Storebrand Livsforsikring AS FRN 21 - 30.09.51	400 000	EUR	296 184	318 700	0,01
			19 373 092	19 498 266	0,81
Pologne					
Bank Polska Kasa Opieki SA FRN 23 - 23.11.27	300 000	EUR	306 927	306 189	0,01
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA FRN 23 - 01.02.26	800 000	EUR	800 457	809 392	0,04
			1 107 384	1 115 581	0,05
Portugal					
Banco Comercial Portugues SA FRN 21 - 12.02.27	300 000	EUR	281 981	283 596	0,01
Banco Comercial Portugues SA FRN 21 - 07.04.28	500 000	EUR	438 645	467 020	0,02
Banco Comercial Portugues SA FRN 23 - 02.10.26	1 100 000	EUR	1 101 605	1 130 998	0,05
			1 822 231	1 881 614	0,08
Roumanie					
Banca Comerciala Romana SA FRN 23 - 19.05.27	800 000	EUR	822 252	844 672	0,04
Raiffeisen Bank SA FRN 23 - 12.10.27	300 000	EUR	303 105	309 390	0,01
			1 125 357	1 154 062	0,05
Singapour					
CapitaLand Ascendas REIT 0.75% 21 - 23.06.28	297 000	EUR	260 696	253 293	0,01
			260 696	253 293	0,01
Slovaquie					
Slovenska Sporitelna AS FRN 23 - 04.10.28	400 000	EUR	399 861	412 492	0,02
			399 861	412 492	0,02
Slovénie					
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. FRN 23 - 29.06.26	400 000	EUR	403 003	412 984	0,02
			403 003	412 984	0,02

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Abertis Infraestructuras SA 0.625% 19 - 15.07.25	700 000	EUR	674 995	670 341	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.00% 16 - 27.02.27	700 000	EUR	657 313	658 126	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.125% 19 - 26.03.28	1 200 000	EUR	1 087 166	1 099 248	0,05
Abertis Infraestructuras SA 1.25% 20 - 07.02.28	900 000	EUR	809 890	829 719	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.375% 16 - 20.05.26	1 200 000	EUR	1 162 249	1 158 660	0,05
Abertis Infraestructuras SA 1.625% 19 - 15.07.29	800 000	EUR	724 396	725 744	0,03
Abertis Infraestructuras SA 1.875% 19 - 26.03.32	900 000	EUR	780 156	779 733	0,03
Abertis Infraestructuras SA 2.25% 20 - 29.03.29	1 400 000	EUR	1 310 214	1 314 516	0,05
Abertis Infraestructuras SA 2.375% 19 - 27.09.27	1 400 000	EUR	1 356 117	1 363 768	0,06
Abertis Infraestructuras SA 2.50% 14 - 27.02.25	900 000	EUR	896 146	887 625	0,04
Abertis Infraestructuras SA 3.00% 19 - 27.03.31	1 400 000	EUR	1 331 591	1 334 718	0,06
Abertis Infraestructuras SA 4.125% 23 - 07.08.29	1 000 000	EUR	971 694	1 027 140	0,04
Abertis Infraestructuras SA 4.125% 23 - 31.01.28	800 000	EUR	796 236	822 872	0,03
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 0.375% 21 - 07.10.27	800 000	EUR	741 102	716 952	0,03
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 1.375% 22 - 26.01.32	600 000	EUR	526 461	502 902	0,02
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 3.75% 23 - 25.04.30	800 000	EUR	796 160	789 712	0,03
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 5.125% 23 - 23.04.31	800 000	EUR	803 150	844 408	0,03
ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA 1.875% 18 - 20.04.26	900 000	EUR	872 127	871 092	0,04
Amadeus IT Group SA 1.50% 18 - 18.09.26	600 000	EUR	587 131	582 630	0,02
Amadeus IT Group SA 1.875% 20 - 24.09.28	700 000	EUR	675 810	667 758	0,03
Amadeus IT Group SA 2.875% 20 - 20.05.27	900 000	EUR	893 566	892 125	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 21 - 24.03.27	1 200 000	EUR	1 127 660	1 117 404	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 15.11.26	1 200 000	EUR	1 142 738	1 111 260	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.50% 20 - 14.01.27	1 500 000	EUR	1 408 036	1 383 645	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 20 - 04.06.25	1 200 000	EUR	1 172 328	1 156 572	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 22 - 14.01.29	1 200 000	EUR	1 089 498	1 088 028	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.00% 19 - 21.06.26	1 200 000	EUR	1 173 220	1 139 724	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 20 - 16.01.30	1 100 000	EUR	1 044 590	1 057 980	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.375% 18 - 14.05.25	1 100 000	EUR	1 084 823	1 067 077	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.75% 22 - 26.11.25	1 700 000	EUR	1 653 427	1 653 811	0,07
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.375% 22 - 20.09.27	1 400 000	EUR	1 370 907	1 413 244	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.50% 17 - 10.02.27	1 200 000	EUR	1 223 974	1 201 332	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 FRN 23 - 10.05.26	1 100 000	EUR	1 098 695	1 107 018	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 4.375% 22 - 14.10.29	1 400 000	EUR	1 421 044	1 487 052	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 23 - 13.01.31	1 100 000	EUR	1 108 396	1 153 812	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 23 - 15.09.33	800 000	EUR	792 667	841 352	0,03
Banco de Sabadell SA 0.875% 19 - 22.07.25	1 200 000	EUR	1 167 681	1 154 880	0,05
Banco de Sabadell SA FRN 20 - 11.03.27	600 000	EUR	563 074	569 430	0,02
Banco de Sabadell SA FRN 23 - 07.06.29	900 000	EUR	899 349	946 008	0,04
Banco de Sabadell SA FRN 22 - 10.11.28	900 000	EUR	910 705	946 089	0,04
Banco Santander SA 0.20% 21 - 11.02.28	1 500 000	EUR	1 369 073	1 326 570	0,06
Banco Santander SA 0.30% 19 - 04.10.26	1 100 000	EUR	1 054 713	1 021 955	0,04
Banco Santander SA 0.50% 20 - 04.02.27	1 300 000	EUR	1 244 651	1 192 802	0,05
Banco Santander SA FRN 21 - 24.03.27	1 100 000	EUR	1 061 833	1 026 575	0,04
Banco Santander SA FRN 21 - 24.06.29	1 100 000	EUR	982 238	973 907	0,04
Banco Santander SA 1.00% 21 - 04.11.31	1 000 000	EUR	855 579	856 350	0,04
Banco Santander SA 1.125% 18 - 17.01.25	1 400 000	EUR	1 386 663	1 362 144	0,06
Banco Santander SA 1.125% 20 - 23.06.27	1 100 000	EUR	1 068 219	1 026 575	0,04
Banco Santander SA 1.375% 20 - 05.01.26	1 900 000	EUR	1 870 227	1 822 385	0,08
Banco Santander SA 1.625% 20 - 22.10.30	1 100 000	EUR	973 762	947 463	0,04
Banco Santander SA 2.125% 18 - 08.02.28	1 400 000	EUR	1 344 283	1 324 918	0,06
Banco Santander SA 2.50% 15 - 18.03.25	1 600 000	EUR	1 602 879	1 577 920	0,07
Banco Santander SA 3.125% 17 - 19.01.27	1 300 000	EUR	1 309 827	1 289 067	0,05
Banco Santander SA 3.25% 16 - 04.04.26	1 700 000	EUR	1 705 552	1 689 341	0,07
Banco Santander SA FRN 22 - 27.09.26	1 900 000	EUR	1 887 715	1 902 736	0,08
Banco Santander SA 3.75% 23 - 16.01.26	2 200 000	EUR	2 190 028	2 218 634	0,09
Banco Santander SA 3.875% 23 - 16.01.28	1 500 000	EUR	1 497 860	1 535 790	0,06
Banco Santander SA 4.25% 23 - 12.06.30	1 100 000	EUR	1 100 007	1 149 379	0,05
Banco Santander SA FRN 23 - 18.10.27	1 600 000	EUR	1 598 426	1 639 248	0,07
Banco Santander SA 4.875% 23 - 18.10.31	2 500 000	EUR	2 492 807	2 662 025	0,11
Banco Santander SA FRN 23 - 23.08.33	1 800 000	EUR	1 796 253	1 887 426	0,08
Bankinter SA 0.625% 20 - 06.10.27	800 000	EUR	745 621	728 128	0,03
Bankinter SA 0.875% 19 - 08.07.26	1 000 000	EUR	950 884	940 550	0,04
Bankinter SA FRN 21 - 23.12.32	800 000	EUR	692 655	713 056	0,03
Bankinter SA FRN 23 - 03.05.30	600 000	EUR	600 908	622 290	0,03
Bankinter SA FRN 23 - 13.09.31	600 000	EUR	596 693	628 338	0,03
CaixaBank SA 0.375% 20 - 03.02.25	1 100 000	EUR	1 078 258	1 062 072	0,04
CaixaBank SA FRN 20 - 18.11.26	1 100 000	EUR	1 048 779	1 035 287	0,04
CaixaBank SA FRN 21 - 09.02.29	1 200 000	EUR	1 088 910	1 057 716	0,04
CaixaBank SA FRN 22 - 21.01.28	1 000 000	EUR	942 043	922 450	0,04
CaixaBank SA 0.75% 19 - 09.07.26	700 000	EUR	675 901	657 657	0,03
CaixaBank SA FRN 20 - 10.07.26	1 300 000	EUR	1 264 169	1 249 339	0,05
CaixaBank SA FRN 21 - 26.05.28	1 100 000	EUR	1 024 771	1 002 782	0,04
CaixaBank SA 1.125% 19 - 27.03.26	1 100 000	EUR	1 071 850	1 047 541	0,04
CaixaBank SA 1.125% 19 - 12.11.26	900 000	EUR	859 442	845 316	0,03
CaixaBank SA FRN 21 - 18.06.31	1 100 000	EUR	992 386	1 023 814	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.375% 19 - 19.06.26	1 500 000	EUR	1 446 297	1 424 520	0,06
CaixaBank SA FRN 22 - 13.04.26	1 200 000	EUR	1 168 668	1 167 888	0,05
CaixaBank SA FRN 18 - 17.04.30	1 300 000	EUR	1 241 862	1 255 124	0,05
CaixaBank SA 3.75% 22 - 07.09.29	1 100 000	EUR	1 072 446	1 128 171	0,05
CaixaBank SA 4.25% 23 - 06.09.30	1 400 000	EUR	1 403 614	1 453 354	0,06
CaixaBank SA 4.375% 23 - 29.11.33	1 200 000	EUR	1 209 014	1 260 972	0,05
CaixaBank SA FRN 23 - 16.05.27	1 200 000	EUR	1 199 517	1 224 948	0,05
CaixaBank SA FRN 23 - 19.07.29	1 200 000	EUR	1 206 170	1 254 648	0,05
CaixaBank SA FRN 23 - 19.07.34	600 000	EUR	608 058	640 266	0,03
CaixaBank SA FRN 22 - 14.11.30	1 200 000	EUR	1 226 849	1 294 740	0,05
CaixaBank SA FRN 23 - 30.05.34	1 200 000	EUR	1 201 951	1 269 384	0,05
CaixaBank SA FRN 22 - 23.02.33	900 000	EUR	909 274	949 635	0,04
FCC Aqualia SA 2.629% 17 - 08.06.27	880 000	EUR	857 199	860 402	0,04
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU 5.25% 23 - 30.10.29	990 000	EUR	1 010 624	1 062 636	0,04
FCC Servicios Medio Ambiente Holdings SAU 1.661% 19 - 04.12.26	680 000	EUR	660 308	648 149	0,03
Ferrovial Emisiones SA 0.54% 20 - 12.11.28	600 000	EUR	543 923	532 056	0,02
Ferrovial Emisiones SA 1.375% 17 - 31.03.25	700 000	EUR	687 906	681 338	0,03
Ferrovial Emisiones SA 1.382% 20 - 14.05.26	1 100 000	EUR	1 081 873	1 059 421	0,04
Ibercaja Banco SA FRN 23 - 07.06.27	500 000	EUR	499 141	515 650	0,02
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 0.75% 21 - 22.06.29	900 000	EUR	787 848	778 383	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.35% 20 - 14.10.28	400 000	EUR	397 510	368 904	0,02
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.625% 17 - 28.11.25	700 000	EUR	679 389	676 851	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.00% 18 - 17.04.26	700 000	EUR	685 435	677 404	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.50% 17 - 28.11.29	400 000	EUR	379 644	376 924	0,02
Lar Espana Real Estate Socimi SA 1.75% 21 - 22.07.26	300 000	EUR	271 323	269 397	0,01
Mapfre SA 1.625% 16 - 19.05.26	900 000	EUR	894 601	880 443	0,04
Mapfre SA 2.875% 22 - 13.04.30	600 000	EUR	542 409	547 506	0,02
Mapfre SA FRN 18 - 07.09.48	500 000	EUR	496 888	482 650	0,02
Mapfre SA FRN 17 - 31.03.47	800 000	EUR	811 135	788 400	0,03
Merlin Properties Socimi SA 1.375% 21 - 01.06.30	600 000	EUR	501 020	508 680	0,02
Merlin Properties Socimi SA 1.75% 17 - 26.05.25	620 000	EUR	604 574	602 541	0,02
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 16 - 02.11.26	960 000	EUR	930 174	924 125	0,04
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 19 - 04.12.34	600 000	EUR	497 100	474 444	0,02
Merlin Properties Socimi SA 2.375% 17 - 18.09.29	400 000	EUR	382 226	378 868	0,02
Merlin Properties Socimi SA 2.375% 20 - 13.07.27	700 000	EUR	691 868	673 771	0,03
Red Electrica Corp. SA 0.875% 20 - 14.04.25	600 000	EUR	593 220	580 644	0,02
Red Electrica Corp. SA FRN 23 - 31.12.99	700 000	EUR	694 346	712 523	0,03
Red Electrica Financiaciones SAU 0.375% 20 - 24.07.28	1 200 000	EUR	1 103 590	1 085 328	0,05
Red Electrica Financiaciones SAU 0.50% 21 - 24.05.33	700 000	EUR	588 159	573 790	0,02
Red Electrica Financiaciones SAU 1.00% 16 - 21.04.26	600 000	EUR	586 343	576 246	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.125% 15 - 24.04.25	700 000	EUR	693 714	680 792	0,03
Red Electrica Financiaciones SAU 1.25% 18 - 13.03.27	1 000 000	EUR	990 202	953 990	0,04
Santander Consumer Finance SA Zero Coupon 21 - 23.02.26	700 000	EUR	664 182	653 128	0,03
Santander Consumer Finance SA 0.375% 20 - 17.01.25	1 200 000	EUR	1 181 557	1 160 364	0,05
Santander Consumer Finance SA 0.50% 19 - 14.11.26	500 000	EUR	462 798	462 370	0,02
Santander Consumer Finance SA 0.50% 22 - 14.01.27	800 000	EUR	746 578	735 912	0,03
Santander Consumer Finance SA 4.125% 23 - 05.05.28	600 000	EUR	598 967	619 830	0,03
Telefonica Emisiones SA 0.664% 20 - 03.02.30	1 300 000	EUR	1 191 995	1 123 356	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.201% 20 - 21.08.27	1 700 000	EUR	1 620 023	1 586 644	0,07
Telefonica Emisiones SA 1.447% 18 - 22.01.27	1 500 000	EUR	1 456 967	1 430 820	0,06
Telefonica Emisiones SA 1.46% 16 - 13.04.26	2 000 000	EUR	1 967 213	1 930 220	0,08
Telefonica Emisiones SA 1.495% 18 - 11.09.25	1 300 000	EUR	1 286 168	1 263 288	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.528% 17 - 17.01.25	1 600 000	EUR	1 600 742	1 565 456	0,07
Telefonica Emisiones SA 1.715% 17 - 12.01.28	2 000 000	EUR	1 962 796	1 891 880	0,08
Telefonica Emisiones SA 1.788% 19 - 12.03.29	1 300 000	EUR	1 285 801	1 223 989	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.807% 20 - 21.05.32	1 000 000	EUR	945 348	897 660	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.864% 20 - 13.07.40	900 000	EUR	796 500	702 369	0,03
Telefonica Emisiones SA 1.93% 16 - 17.10.31	1 100 000	EUR	1 051 108	1 004 674	0,04
Telefonica Emisiones SA 1.957% 19 - 01.07.39	700 000	EUR	583 862	561 253	0,02
Telefonica Emisiones SA 2.318% 17 - 17.10.28	1 000 000	EUR	969 557	963 850	0,04
Telefonica Emisiones SA 2.592% 22 - 25.05.31	1 500 000	EUR	1 420 619	1 441 305	0,06
Telefonica Emisiones SA 2.932% 14 - 17.10.29	1 200 000	EUR	1 238 212	1 187 064	0,05
Telefonica Emisiones SA 4.183% 23 - 21.11.33	1 300 000	EUR	1 312 500	1 366 053	0,06
Unicaja Banco SA FRN 21 - 01.12.26	600 000	EUR	579 302	566 880	0,02
Unicaja Banco SA FRN 23 - 21.02.29	600 000	EUR	587 073	616 086	0,03
			143 479 627	143 315 410	5,99
Suède					
Assa Abloy AB 3.75% 23 - 13.09.26	1 040 000	EUR	1 040 801	1 059 552	0,04
Assa Abloy AB 3.875% 23 - 13.09.30	940 000	EUR	937 890	987 028	0,04
Assa Abloy AB 4.125% 23 - 13.09.35	840 000	EUR	831 976	921 497	0,04
Atlas Copco AB 0.625% 16 - 30.08.26	775 000	EUR	746 751	731 305	0,03
Castellum AB 0.75% 19 - 04.09.26	440 000	EUR	398 025	398 310	0,02
Electrolux AB 2.50% 22 - 18.05.30	680 000	EUR	635 825	624 498	0,03
Electrolux AB 4.125% 22 - 05.10.26	750 000	EUR	755 750	761 362	0,03
Electrolux AB 4.50% 23 - 29.09.28	400 000	EUR	397 708	409 256	0,02
EQT AB 0.875% 21 - 14.05.31	650 000	EUR	536 410	515 840	0,02
EQT AB 2.375% 22 - 06.04.28	810 000	EUR	763 818	764 267	0,03
EQT AB 2.875% 22 - 06.04.32	890 000	EUR	792 743	791 415	0,03
Essity AB 0.25% 21 - 08.02.31	900 000	EUR	779 272	766 602	0,03
Essity AB 0.50% 20 - 03.02.30	200 000	EUR	174 877	175 352	0,01
Essity AB 1.125% 15 - 05.03.25	380 000	EUR	374 876	369 219	0,02
Essity AB 1.625% 17 - 30.03.27	810 000	EUR	790 051	775 445	0,03
Investor AB 0.375% 20 - 29.10.35	860 000	EUR	607 267	622 950	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Investor AB 1.50% 18 - 12.09.30	620 000	EUR	559 346	564 051	0,02
Investor AB 1.50% 19 - 20.06.39	720 000	EUR	542 512	547 027	0,02
Investor AB 2.75% 22 - 10.06.32	960 000	EUR	902 440	932 506	0,04
Molnlycke Holding AB 4.25% 23 - 08.09.28	600 000	EUR	594 053	616 014	0,03
Molnlycke Holdings AB 0.625% 20 - 15.01.31	700 000	EUR	550 200	565 922	0,02
Molnlycke Holdings AB 0.875% 19 - 05.09.29	700 000	EUR	587 707	602 763	0,03
Molnlycke Holdings AB 1.875% 17 - 28.02.25	600 000	EUR	587 909	585 996	0,02
Nordea Bank Abp FRN 21 - 18.08.31	1 270 000	EUR	1 171 708	1 167 232	0,05
Sagax AB 1.125% 20 - 30.01.27	300 000	EUR	275 504	269 817	0,01
Sagax AB 2.25% 19 - 13.03.25	430 000	EUR	421 625	418 240	0,02
Sandvik AB 0.375% 21 - 25.11.28	710 000	EUR	642 280	624 701	0,03
Sandvik AB 2.125% 22 - 07.06.27	940 000	EUR	905 694	911 593	0,04
Sandvik AB 3.00% 14 - 18.06.26	500 000	EUR	518 890	495 165	0,02
Sandvik AB 3.75% 22 - 27.09.29	650 000	EUR	642 362	672 165	0,03
Securitas AB 0.25% 21 - 22.02.28	500 000	EUR	433 357	440 570	0,02
Securitas AB 1.25% 18 - 06.03.25	280 000	EUR	271 069	271 071	0,01
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.375% 20 - 11.02.27	1 160 000	EUR	1 102 375	1 057 317	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.375% 21 - 21.06.28	1 340 000	EUR	1 213 825	1 171 441	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.625% 19 - 12.11.29	1 200 000	EUR	1 093 130	1 023 540	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 21 - 03.11.31	560 000	EUR	521 256	509 740	0,02
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.75% 22 - 09.08.27	1 100 000	EUR	1 033 887	1 000 648	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.75% 22 - 11.11.26	1 270 000	EUR	1 219 603	1 219 632	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.25% 22 - 24.11.25	1 270 000	EUR	1 261 297	1 270 927	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.75% 23 - 07.02.28	1 150 000	EUR	1 130 371	1 162 673	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.875% 23 - 09.05.28	1 200 000	EUR	1 199 096	1 228 944	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.00% 22 - 09.11.26	1 150 000	EUR	1 156 257	1 170 102	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.125% 23 - 29.06.27	1 070 000	EUR	1 069 529	1 102 121	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.375% 23 - 06.11.28	580 000	EUR	580 960	601 704	0,02
Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 23 - 17.08.33	500 000	EUR	497 830	519 750	0,02
SKF AB 0.25% 21 - 15.02.31	464 000	EUR	365 524	369 423	0,02
SKF AB 0.875% 19 - 15.11.29	470 000	EUR	437 572	411 250	0,02
SKF AB 1.25% 18 - 17.09.25	390 000	EUR	378 678	376 518	0,02
SKF AB 3.125% 22 - 14.09.28	540 000	EUR	524 149	540 022	0,02
Svenska Handelsbanken AB 0.01% 20 - 02.12.27	750 000	EUR	673 553	663 473	0,03
Svenska Handelsbanken AB 0.05% 19 - 03.09.26	790 000	EUR	765 787	726 595	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.05% 21 - 06.09.28	1 140 000	EUR	1 037 426	992 062	0,04
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 21 - 03.11.26	1 170 000	EUR	1 095 441	1 075 230	0,04
Svenska Handelsbanken AB 0.50% 20 - 18.02.30	1 041 000	EUR	956 438	881 540	0,04
Svenska Handelsbanken AB 1.00% 20 - 15.04.25	1 400 000	EUR	1 377 354	1 358 406	0,06
Svenska Handelsbanken AB 1.375% 22 - 23.02.29	1 340 000	EUR	1 273 214	1 223 782	0,05
Svenska Handelsbanken AB 2.625% 22 - 05.09.29	970 000	EUR	933 847	947 447	0,04
Svenska Handelsbanken AB FRN 22 - 01.06.33	500 000	EUR	476 768	487 495	0,02
Svenska Handelsbanken AB 3.375% 23 - 17.02.28	1 150 000	EUR	1 127 790	1 160 603	0,05
Svenska Handelsbanken AB 3.75% 22 - 01.11.27	820 000	EUR	824 613	841 361	0,03
Svenska Handelsbanken AB 3.75% 23 - 05.05.26	1 600 000	EUR	1 597 449	1 620 288	0,07
Svenska Handelsbanken AB 3.875% 23 - 10.05.27	900 000	EUR	904 347	918 405	0,04
Svenska Handelsbanken AB FRN 23 - 16.08.34	890 000	EUR	886 489	932 996	0,04
Swedbank AB 0.20% 21 - 12.01.28	880 000	EUR	795 303	767 166	0,03
Swedbank AB 0.25% 21 - 02.11.26	1 300 000	EUR	1 221 762	1 199 640	0,05
Swedbank AB FRN 21 - 20.05.27	1 170 000	EUR	1 115 044	1 080 869	0,05
Swedbank AB 0.75% 20 - 05.05.25	1 139 000	EUR	1 126 123	1 098 019	0,05
Swedbank AB 1.30% 22 - 17.02.27	760 000	EUR	717 067	707 507	0,03
Swedbank AB 2.10% 22 - 25.05.27	1 200 000	EUR	1 172 553	1 155 036	0,05
Swedbank AB FRN 22 - 23.08.32	860 000	EUR	821 448	840 710	0,03
Swedbank AB 3.75% 22 - 14.11.25	1 000 000	EUR	1 001 969	1 008 530	0,04
Swedbank AB 4.125% 23 - 13.11.28	1 100 000	EUR	1 114 165	1 139 611	0,05
Swedbank AB 4.25% 23 - 11.07.28	900 000	EUR	896 315	924 642	0,04
Swedbank AB 4.375% 23 - 05.09.30	570 000	EUR	565 975	590 845	0,02
Swedbank AB 4.625% 23 - 30.05.26	1 000 000	EUR	1 000 775	1 010 490	0,04
Tele2 AB 0.75% 21 - 23.03.31	300 000	EUR	248 518	250 791	0,01
Tele2 AB 2.125% 18 - 15.05.28	890 000	EUR	844 683	852 113	0,04
Tele2 AB 3.75% 23 - 22.11.29	800 000	EUR	796 054	821 040	0,03
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.00% 21 - 26.05.29	750 000	EUR	625 499	635 415	0,03
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.125% 22 - 08.02.27	980 000	EUR	905 526	905 451	0,04
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 5.375% 23 - 29.05.28	700 000	EUR	709 577	731 493	0,03
Telia Co. AB 0.125% 20 - 27.11.30	760 000	EUR	642 133	621 475	0,03
Telia Co. AB FRN 20 - 11.05.81	716 000	EUR	659 126	664 985	0,03
Telia Co. AB 1.625% 15 - 23.02.35	680 000	EUR	615 395	574 770	0,02
Telia Co. AB 2.125% 19 - 20.02.34	710 000	EUR	671 035	640 399	0,03
Telia Co. AB FRN 22 - 30.06.83	800 000	EUR	726 082	736 008	0,03
Telia Co. AB 3.00% 12 - 07.09.27	770 000	EUR	802 950	772 110	0,03
Telia Co. AB 3.50% 13 - 05.09.33	660 000	EUR	693 624	676 883	0,03
Telia Co. AB 3.625% 23 - 22.02.32	800 000	EUR	787 369	828 096	0,03
Telia Co. AB 3.875% 10 - 01.10.25	1 110 000	EUR	1 136 500	1 123 020	0,05
Telia Co. AB FRN 22 - 21.12.82	840 000	EUR	818 104	837 841	0,03
Volvo Treasury AB Zero Coupon 21 - 18.05.26	780 000	EUR	742 959	725 096	0,03
Volvo Treasury AB 0.625% 22 - 14.02.25	650 000	EUR	641 060	629 077	0,03
Volvo Treasury AB 1.625% 20 - 26.05.25	610 000	EUR	603 156	594 994	0,02
Volvo Treasury AB 1.625% 22 - 18.09.25	850 000	EUR	837 775	825 919	0,03
Volvo Treasury AB 2.00% 22 - 19.08.27	600 000	EUR	574 348	579 408	0,02
Volvo Treasury AB 2.625% 22 - 20.02.26	970 000	EUR	956 659	958 670	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Volvo Treasury AB 3.50% 23 - 17.11.25	1 010 000	EUR	1 004 650	1 014 292	0,04
Volvo Treasury AB 3.625% 23 - 25.05.27	830 000	EUR	829 389	844 284	0,04
Volvo Treasury AB 3.875% 23 - 29.08.26	1 070 000	EUR	1 068 452	1 090 234	0,05
			79 375 673	79 381 095	3,32
Suisse					
Credit Suisse AG 0.25% 21 - 05.01.26	1 570 000	EUR	1 487 849	1 473 241	0,06
Credit Suisse AG 0.25% 21 - 01.09.28	1 400 000	EUR	1 239 571	1 217 538	0,05
Credit Suisse AG 0.45% 20 - 19.05.25	630 000	EUR	605 462	604 794	0,02
Credit Suisse AG 1.50% 16 - 10.04.26	1 790 000	EUR	1 754 303	1 714 032	0,07
Credit Suisse AG 5.50% 23 - 20.08.26	900 000	EUR	886 929	945 828	0,04
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 4.84% 23 - 03.11.28	600 000	EUR	605 023	625 830	0,03
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 5.23% 22 - 01.11.27	600 000	EUR	614 185	636 060	0,03
UBS AG 0.01% 21 - 31.03.26	1 970 000	EUR	1 897 378	1 835 016	0,08
UBS AG 0.01% 21 - 29.06.26	680 000	EUR	638 262	629 626	0,03
UBS AG 0.50% 21 - 31.03.31	1 240 000	EUR	1 101 833	1 013 898	0,04
UBS Group AG FRN 20 - 29.01.26	1 842 000	EUR	1 795 415	1 765 354	0,07
UBS Group AG FRN 20 - 05.11.28	1 600 000	EUR	1 444 580	1 407 904	0,06
UBS Group AG 0.25% 21 - 24.02.28	1 210 000	EUR	1 089 217	1 064 328	0,04
UBS Group AG FRN 21 - 03.11.26	1 430 000	EUR	1 367 478	1 341 354	0,06
UBS Group AG 0.625% 21 - 18.01.33	1 800 000	EUR	1 355 586	1 357 956	0,06
UBS Group AG 0.625% 21 - 24.02.33	1 450 000	EUR	1 222 511	1 112 063	0,05
UBS Group AG 0.65% 19 - 10.09.29	1 100 000	EUR	902 814	936 177	0,04
UBS Group AG FRN 20 - 14.01.28	1 480 000	EUR	1 362 455	1 352 587	0,06
UBS Group AG 0.875% 21 - 03.11.31	1 500 000	EUR	1 339 645	1 210 410	0,05
UBS Group AG FRN 19 - 24.06.27	1 570 000	EUR	1 453 445	1 473 900	0,06
UBS Group AG 1.25% 16 - 01.09.26	1 280 000	EUR	1 254 673	1 216 922	0,05
UBS Group AG FRN 22 - 13.10.26	2 440 000	EUR	2 335 587	2 370 631	0,10
UBS Group AG FRN 22 - 15.06.27	1 070 000	EUR	1 054 699	1 048 333	0,04
UBS Group AG FRN 22 - 02.04.32	1 850 000	EUR	1 680 390	1 728 270	0,07
UBS Group AG FRN 22 - 15.06.30	1 050 000	EUR	1 024 147	1 021 388	0,04
UBS Group AG FRN 20 - 02.04.26	2 351 000	EUR	2 347 269	2 330 076	0,10
UBS Group AG FRN 23 - 11.01.31	1 250 000	EUR	1 250 775	1 289 512	0,05
UBS Group AG FRN 23 - 17.03.28	1 200 000	EUR	1 202 490	1 234 176	0,05
UBS Group AG FRN 23 - 17.03.32	1 160 000	EUR	1 166 841	1 222 141	0,05
UBS Group AG FRN 22 - 01.03.29	3 530 000	EUR	3 567 870	4 067 901	0,17
			41 048 682	41 247 246	1,72
Royaume-Uni					
3i Group PLC 4.875% 23 - 14.06.29	550 000	EUR	543 431	574 822	0,02
Aon Global Ltd. 2.875% 14 - 14.05.26	500 000	EUR	485 152	491 800	0,02
AstraZeneca PLC 0.375% 21 - 03.06.29	1 340 000	EUR	1 214 557	1 178 999	0,05
AstraZeneca PLC 1.25% 16 - 12.05.28	1 100 000	EUR	1 054 125	1 034 869	0,04
AstraZeneca PLC 3.625% 23 - 03.03.27	1 200 000	EUR	1 202 411	1 227 612	0,05
AstraZeneca PLC 3.75% 23 - 03.03.32	1 070 000	EUR	1 071 485	1 126 389	0,05
Aviva PLC 1.875% 18 - 13.11.27	500 000	EUR	463 780	488 060	0,02
Aviva PLC FRN 15 - 04.12.45	1 000 000	EUR	950 187	974 970	0,04
Barclays PLC FRN 21 - 09.08.29	1 840 000	EUR	1 628 186	1 583 780	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Barclays PLC FRN 22 - 28.01.28	1 480 000	EUR	1 379 065	1 358 625	0,06
Barclays PLC FRN 21 - 12.05.32	1 380 000	EUR	1 171 372	1 125 114	0,05
Barclays PLC FRN 21 - 22.03.31	1 070 000	EUR	1 009 016	985 866	0,04
Barclays PLC FRN 18 - 24.01.26	1 170 000	EUR	1 145 113	1 136 351	0,05
Barclays PLC FRN 22 - 31.01.27	1 140 000	EUR	1 125 382	1 120 951	0,05
Barclays PLC FRN 23 - 08.08.30	1 450 000	EUR	1 454 380	1 511 480	0,06
Barclays PLC FRN 22 - 29.01.34	1 500 000	EUR	1 511 389	1 605 960	0,07
Brambles Finance PLC 1.50% 17 - 04.10.27	700 000	EUR	674 380	659 589	0,03
Brambles Finance PLC 4.25% 23 - 22.03.31	720 000	EUR	727 319	759 247	0,03
British Telecommunications PLC 0.50% 19 - 12.09.25	920 000	EUR	885 372	876 438	0,04
British Telecommunications PLC 1.125% 19 - 12.09.29	1 130 000	EUR	1 013 790	1 013 983	0,04
British Telecommunications PLC 1.50% 17 - 23.06.27	1 670 000	EUR	1 617 029	1 579 453	0,07
British Telecommunications PLC 1.75% 16 - 10.03.26	1 940 000	EUR	1 931 581	1 881 703	0,08
British Telecommunications PLC 2.125% 18 - 26.09.28	610 000	EUR	580 596	584 648	0,02
British Telecommunications PLC 2.75% 22 - 30.08.27	1 020 000	EUR	989 801	1 007 923	0,04
British Telecommunications PLC 3.375% 22 - 30.08.32	800 000	EUR	777 242	800 064	0,03
British Telecommunications PLC 3.75% 23 - 13.05.31	1 100 000	EUR	1 064 955	1 130 877	0,05
British Telecommunications PLC 4.25% 23 - 06.01.33	1 290 000	EUR	1 279 662	1 358 499	0,06
BUPA Finance PLC 5.00% 23 - 12.10.30	588 000	EUR	594 786	631 665	0,03
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0.20% 20 - 02.12.28	1 240 000	EUR	1 157 848	1 082 049	0,05
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0.70% 19 - 12.09.31	630 000	EUR	556 281	527 197	0,02
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.125% 19 - 12.04.29	840 000	EUR	771 127	761 888	0,03
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.50% 18 - 08.11.27	1 000 000	EUR	962 431	944 890	0,04
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.75% 16 - 26.05.28	620 000	EUR	610 037	588 659	0,02
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.75% 20 - 27.03.26	946 000	EUR	942 029	919 720	0,04
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.875% 15 - 18.03.30	550 000	EUR	511 301	509 911	0,02
Coca-Cola Europacific Partners PLC 2.375% 13 - 07.05.25	500 000	EUR	499 248	493 205	0,02
DS Smith PLC 0.875% 19 - 12.09.26	750 000	EUR	703 114	699 743	0,03
DS Smith PLC 4.375% 23 - 27.07.27	1 390 000	EUR	1 391 139	1 430 338	0,06
DS Smith PLC 4.50% 23 - 27.07.30	860 000	EUR	855 128	895 939	0,04
easyJet PLC 0.875% 19 - 11.06.25	751 000	EUR	724 286	721 831	0,03
Experian Finance PLC 1.375% 17 - 25.06.26	900 000	EUR	860 538	860 706	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.00% 17 - 12.09.26	889 000	EUR	875 343	847 564	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.25% 18 - 21.05.26	1 500 000	EUR	1 475 546	1 443 165	0,06
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 17 - 12.09.29	650 000	EUR	607 717	602 225	0,02
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.75% 18 - 21.05.30	1 180 000	EUR	1 148 201	1 105 318	0,05
GlaxoSmithKline Capital PLC 4.00% 05 - 16.06.25	1 079 000	EUR	1 101 327	1 089 499	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
HBOS PLC FRN 05 - 18.03.30	500 000	EUR	509 009	498 330	0,02
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 13.11.26	1 120 000	EUR	1 063 907	1 055 275	0,04
HSBC Holdings PLC FRN 21 - 24.09.29	1 260 000	EUR	1 183 829	1 105 411	0,05
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 13.11.31	949 000	EUR	789 536	795 442	0,03
HSBC Holdings PLC 2.50% 16 - 15.03.27	1 450 000	EUR	1 480 179	1 422 203	0,06
HSBC Holdings PLC 3.00% 15 - 30.06.25	1 850 000	EUR	1 866 329	1 830 871	0,08
HSBC Holdings PLC FRN 22 - 15.06.27	2 240 000	EUR	2 209 781	2 212 538	0,09
HSBC Holdings PLC 3.125% 16 - 07.06.28	1 000 000	EUR	969 637	983 200	0,04
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 10.03.28	1 730 000	EUR	1 745 734	1 794 287	0,07
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 10.03.32	1 560 000	EUR	1 584 251	1 649 372	0,07
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 23.05.33	2 100 000	EUR	2 120 620	2 226 336	0,09
HSBC Holdings PLC FRN 22 - 16.11.32	1 440 000	EUR	1 474 352	1 549 512	0,06
Informa PLC 1.25% 19 - 22.04.28	650 000	EUR	591 843	595 264	0,02
Informa PLC 2.125% 20 - 06.10.25	1 200 000	EUR	1 178 304	1 166 016	0,05
InterContinental Hotels Group PLC 2.125% 18 - 15.05.27	760 000	EUR	729 596	732 663	0,03
Intermediate Capital Group PLC 1.625% 20 - 17.02.27	666 000	EUR	616 359	614 525	0,03
Intermediate Capital Group PLC 2.50% 22 - 28.01.30	550 000	EUR	469 217	484 347	0,02
International Distributions Services PLC 1.25% 19 - 08.10.26	660 000	EUR	630 902	616 400	0,03
International Distributions Services PLC 5.25% 23 - 14.09.28	780 000	EUR	780 930	809 546	0,03
Investec Bank PLC FRN 21 - 17.02.27	310 000	EUR	277 677	283 349	0,01
Investec Bank PLC FRN 22 - 11.08.26	60 000	EUR	57 237	56 273	0,00
Investec Bank PLC FRN 22 - 11.08.26	200 000	EUR	185 970	187 576	0,01
ITV PLC 1.375% 19 - 26.09.26	830 000	EUR	783 439	781 022	0,03
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 0.375% 20 - 28.01.25	801 000	EUR	789 521	773 197	0,03
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 2.375% 20 - 09.04.26	1 346 000	EUR	1 347 843	1 321 960	0,06
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 4.125% 23 - 30.05.27	900 000	EUR	900 023	921 276	0,04
Lloyds Bank PLC 1.25% 15 - 13.01.25	1 000 000	EUR	1 001 814	974 030	0,04
Lloyds Banking Group PLC 1.50% 17 - 12.09.27	1 030 000	EUR	1 001 734	973 175	0,04
Lloyds Banking Group PLC FRN 22 - 24.08.30	1 210 000	EUR	1 157 497	1 177 681	0,05
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 01.04.26	1 805 000	EUR	1 843 747	1 799 567	0,07
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 18.03.30	320 000	EUR	315 720	319 174	0,01
Lloyds Banking Group PLC FRN 23 - 11.01.29	700 000	EUR	701 375	727 020	0,03
Lloyds Banking Group PLC FRN 23 - 21.09.31	1 540 000	EUR	1 524 757	1 627 102	0,07
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 17 - 19.09.29	470 000	EUR	464 822	439 422	0,02
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 18 - 06.12.27	475 000	EUR	462 686	454 903	0,02
Mitsubishi HC Capital UK PLC 0.25% 22 - 03.02.25	430 000	EUR	415 793	412 073	0,02
Mobico Group PLC 4.875% 23 - 26.09.31	700 000	EUR	679 451	711 438	0,03
Mondi Finance PLC 1.625% 18 - 27.04.26	950 000	EUR	917 608	917 073	0,04
Motability Operations Group PLC 0.125% 21 - 20.07.28	500 000	EUR	439 250	439 975	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Motability Operations Group PLC 0.375% 19 - 03.01.26	930 000	EUR	904 181	879 743	0,04
Motability Operations Group PLC 0.875% 17 - 14.03.25	790 000	EUR	779 479	766 711	0,03
Motability Operations Group PLC 3.50% 23 - 17.07.31	800 000	EUR	777 618	820 160	0,03
Nationwide Building Society 0.25% 20 - 22.07.25	1 330 000	EUR	1 287 139	1 265 854	0,05
Nationwide Building Society 0.25% 21 - 14.09.28	800 000	EUR	719 340	698 200	0,03
Nationwide Building Society 1.25% 15 - 03.03.25	1 050 000	EUR	1 042 370	1 021 891	0,04
Nationwide Building Society FRN 18 - 08.03.26	1 238 000	EUR	1 231 587	1 204 896	0,05
Nationwide Building Society 2.00% 22 - 28.04.27	1 010 000	EUR	982 442	971 166	0,04
Nationwide Building Society 3.25% 22 - 05.09.29	800 000	EUR	771 915	798 648	0,03
Nationwide Building Society 4.50% 23 - 01.11.26	1 569 000	EUR	1 580 576	1 618 329	0,07
NatWest Group PLC FRN 21 - 14.09.29	1 100 000	EUR	1 029 478	955 295	0,04
NatWest Group PLC FRN 21 - 26.02.30	1 340 000	EUR	1 220 729	1 153 941	0,05
NatWest Group PLC FRN 21 - 14.09.32	780 000	EUR	699 089	689 083	0,03
NatWest Group PLC FRN 18 - 02.03.26	1 720 000	EUR	1 723 657	1 674 781	0,07
NatWest Group PLC FRN 22 - 06.09.28	1 270 000	EUR	1 253 074	1 293 266	0,05
NatWest Group PLC FRN 23 - 14.03.28	620 000	EUR	621 538	637 980	0,03
NatWest Group PLC FRN 23 - 16.02.29	1 120 000	EUR	1 121 828	1 164 699	0,05
NatWest Group PLC FRN 23 - 28.02.34	810 000	EUR	811 870	852 193	0,04
NatWest Markets PLC 0.125% 21 - 18.06.26	1 330 000	EUR	1 290 472	1 232 444	0,05
NatWest Markets PLC 0.125% 21 - 12.11.25	1 230 000	EUR	1 172 207	1 158 758	0,05
NatWest Markets PLC 1.375% 22 - 02.03.27	970 000	EUR	936 726	912 925	0,04
NatWest Markets PLC 2.00% 22 - 27.08.25	1 000 000	EUR	983 680	975 130	0,04
NatWest Markets PLC 2.75% 20 - 02.04.25	1 240 000	EUR	1 246 198	1 228 530	0,05
NatWest Markets PLC 4.25% 23 - 13.01.28	900 000	EUR	898 827	930 249	0,04
Omnicom Finance Holdings PLC 0.80% 19 - 08.07.27	790 000	EUR	724 529	729 905	0,03
Omnicom Finance Holdings PLC 1.40% 19 - 08.07.31	650 000	EUR	550 109	582 140	0,02
OTE PLC 0.875% 19 - 24.09.26	850 000	EUR	809 218	797 870	0,03
Pearson Funding PLC 1.375% 15 - 06.05.25	400 000	EUR	395 116	386 336	0,02
Phoenix Group Holdings PLC 4.375% 18 - 24.01.29	550 000	EUR	546 091	526 136	0,02
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 3.625% 23 - 14.09.28	1 020 000	EUR	1 009 910	1 054 833	0,04
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 3.875% 23 - 14.09.33	1 170 000	EUR	1 158 214	1 238 714	0,05
Rentokil Initial PLC 0.50% 20 - 14.10.28	740 000	EUR	664 954	655 507	0,03
Rentokil Initial PLC 0.875% 19 - 30.05.26	850 000	EUR	813 226	804 406	0,03
Sage Group PLC 3.82% 23 - 15.02.28	700 000	EUR	690 168	719 936	0,03
Santander UK Group Holdings PLC FRN 21 - 13.09.29	870 000	EUR	757 113	748 374	0,03
Santander UK Group Holdings PLC FRN 22 - 25.08.28	800 000	EUR	772 274	794 072	0,03
Santander UK PLC 1.125% 15 - 10.03.25	650 000	EUR	634 265	630 240	0,03
Sky Ltd. 2.25% 15 - 17.11.25	800 000	EUR	782 120	786 504	0,03
Sky Ltd. 2.50% 14 - 15.09.26	1 330 000	EUR	1 302 948	1 310 343	0,05
Sky Ltd. 2.75% 14 - 27.11.29	370 000	EUR	358 046	373 238	0,02
Smith & Nephew PLC 4.565% 22 - 11.10.29	710 000	EUR	713 917	753 083	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Smiths Group PLC 2.00% 17 - 23.02.27	920 000	EUR	881 086	891 563	0,04
Standard Chartered PLC FRN 21 - 17.11.29	550 000	EUR	486 175	478 577	0,02
Standard Chartered PLC FRN 20 - 27.01.28	746 000	EUR	699 054	683 388	0,03
Standard Chartered PLC FRN 19 - 02.07.27	670 000	EUR	627 449	625 994	0,03
Standard Chartered PLC FRN 21 - 23.09.31	1 170 000	EUR	1 092 676	1 061 307	0,04
Standard Chartered PLC FRN 17 - 03.10.27	460 000	EUR	440 340	436 052	0,02
Standard Chartered PLC FRN 20 - 09.09.30	1 370 000	EUR	1 328 607	1 325 968	0,06
Standard Chartered PLC FRN 23 - 10.05.31	1 180 000	EUR	1 185 028	1 234 846	0,05
Swiss Re Finance UK PLC FRN 20 - 04.06.52	1 000 000	EUR	923 318	886 530	0,04
Thames Water Utilities Finance PLC 0.875% 22 - 31.01.28	880 000	EUR	804 864	751 502	0,03
Thames Water Utilities Finance PLC 1.25% 22 - 31.01.32	700 000	EUR	597 796	526 533	0,02
Thames Water Utilities Finance PLC 4.00% 23 - 18.04.27	1 000 000	EUR	987 283	967 820	0,04
Thames Water Utilities Finance PLC 4.375% 23 - 18.01.31	1 500 000	EUR	1 500 266	1 415 625	0,06
Virgin Money UK PLC FRN 23 - 29.10.28	480 000	EUR	469 226	478 853	0,02
Vodafone Group PLC 0.90% 19 - 24.11.26	1 070 000	EUR	1 043 172	1 014 424	0,04
Vodafone Group PLC 1.125% 17 - 20.11.25	1 500 000	EUR	1 458 624	1 443 975	0,06
Vodafone Group PLC 1.50% 17 - 24.07.27	580 000	EUR	574 647	553 546	0,02
Vodafone Group PLC 1.60% 16 - 29.07.31	1 840 000	EUR	1 725 128	1 648 640	0,07
Vodafone Group PLC 1.625% 19 - 24.11.30	1 410 000	EUR	1 299 752	1 278 828	0,05
Vodafone Group PLC 1.875% 14 - 11.09.25	1 570 000	EUR	1 566 213	1 530 357	0,06
Vodafone Group PLC 1.875% 17 - 20.11.29	1 045 000	EUR	1 026 655	975 424	0,04
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	2 580 000	EUR	2 582 687	2 531 109	0,11
Vodafone Group PLC 2.50% 19 - 24.05.39	1 050 000	EUR	960 446	916 094	0,04
Vodafone Group PLC 2.875% 17 - 20.11.37	1 000 000	EUR	967 365	922 690	0,04
Wellcome Trust Ltd. 1.125% 15 - 21.01.27	500 000	EUR	508 213	476 165	0,02
WPP Finance 2016 1.375% 18 - 20.03.25	720 000	EUR	706 223	699 955	0,03
Yorkshire Building Society 0.50% 21 - 01.07.28	580 000	EUR	548 286	507 633	0,02
Yorkshire Building Society 0.625% 20 - 21.09.25	570 000	EUR	542 027	541 130	0,02
			147 861 308	147 373 445	6,15
États-Unis					
3M Co. 1.50% 14 - 09.11.26	1 020 000	EUR	1 002 534	961 442	0,04
3M Co. 1.50% 16 - 02.06.31	680 000	EUR	663 989	579 346	0,02
3M Co. 1.75% 15 - 15.05.30	810 000	EUR	787 612	720 997	0,03
AbbVie Inc. 0.75% 19 - 18.11.27	1 080 000	EUR	1 012 526	996 408	0,04
AbbVie Inc. 1.25% 19 - 18.11.31	840 000	EUR	753 718	733 387	0,03
AbbVie Inc. 1.25% 19 - 18.11.31	100 000	EUR	81 850	87 308	0,00
AbbVie Inc. 2.125% 16 - 17.11.28	1 080 000	EUR	1 084 034	1 040 753	0,04
AbbVie Inc. 2.125% 20 - 01.06.29	810 000	EUR	782 858	773 834	0,03
AbbVie Inc. 2.625% 20 - 15.11.28	200 000	EUR	197 044	196 682	0,01
AbbVie Inc. 2.625% 20 - 15.11.28	360 000	EUR	346 569	354 028	0,01
Air Products and Chemicals Inc. 0.50% 20 - 05.05.28	650 000	EUR	615 805	587 106	0,02
Air Products and Chemicals Inc. 0.80% 20 - 05.05.32	733 000	EUR	627 815	608 397	0,03
Air Products and Chemicals Inc. 1.00% 15 - 12.02.25	490 000	EUR	486 262	477 887	0,02
Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 23 - 03.03.35	1 020 000	EUR	1 014 441	1 076 141	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Alcon Finance BV 2.375% 22 - 31.05.28	690 000	EUR	668 180	666 851	0,03
American Honda Finance Corp. 0.30% 21 - 07.07.28	1 800 000	EUR	1 678 885	1 593 540	0,07
American Honda Finance Corp. 3.75% 23 - 25.10.27	1 130 000	EUR	1 126 857	1 159 165	0,05
American International Group Inc. 1.875% 17 - 21.06.27	954 000	EUR	928 593	913 169	0,04
American Tower Corp. 0.40% 21 - 15.02.27	710 000	EUR	657 413	647 030	0,03
American Tower Corp. 0.45% 21 - 15.01.27	1 150 000	EUR	1 070 251	1 051 767	0,04
American Tower Corp. 0.50% 20 - 15.01.28	1 240 000	EUR	1 116 349	1 105 857	0,05
American Tower Corp. 0.875% 21 - 21.05.29	1 280 000	EUR	1 144 438	1 115 814	0,05
American Tower Corp. 0.95% 21 - 05.10.30	700 000	EUR	599 646	587 083	0,02
American Tower Corp. 1.00% 20 - 15.01.32	900 000	EUR	777 049	736 308	0,03
American Tower Corp. 1.25% 21 - 21.05.33	550 000	EUR	455 155	442 778	0,02
American Tower Corp. 1.375% 17 - 04.04.25	600 000	EUR	592 565	582 414	0,02
American Tower Corp. 1.95% 18 - 22.05.26	580 000	EUR	566 689	559 410	0,02
American Tower Corp. 4.125% 23 - 16.05.27	990 000	EUR	987 389	1 011 582	0,04
American Tower Corp. 4.625% 23 - 16.05.31	730 000	EUR	726 772	769 077	0,03
Amgen Inc. 2.00% 16 - 25.02.26	1 179 000	EUR	1 166 753	1 151 435	0,05
Apple Inc. Zero Coupon 19 - 15.11.25	1 429 000	EUR	1 367 753	1 354 892	0,06
Apple Inc. 0.50% 19 - 15.11.31	1 500 000	EUR	1 317 799	1 277 955	0,05
Apple Inc. 0.875% 17 - 24.05.25	1 850 000	EUR	1 828 013	1 792 502	0,08
Apple Inc. 1.375% 17 - 24.05.29	1 830 000	EUR	1 784 196	1 719 395	0,07
Apple Inc. 1.625% 14 - 10.11.26	2 120 000	EUR	2 104 656	2 059 114	0,09
Apple Inc. 2.00% 15 - 17.09.27	1 430 000	EUR	1 443 628	1 399 169	0,06
AT&T Inc. 0.25% 19 - 04.03.26	1 440 000	EUR	1 343 851	1 351 829	0,06
AT&T Inc. 0.80% 19 - 04.03.30	1 820 000	EUR	1 513 231	1 581 926	0,07
AT&T Inc. 1.60% 20 - 19.05.28	2 580 000	EUR	2 354 483	2 421 614	0,10
AT&T Inc. 1.80% 18 - 05.09.26	2 110 000	EUR	2 010 580	2 036 867	0,09
AT&T Inc. 1.80% 19 - 14.09.39	1 040 000	EUR	739 597	792 137	0,03
AT&T Inc. 2.05% 20 - 19.05.32	1 120 000	EUR	967 091	1 011 136	0,04
AT&T Inc. 2.35% 18 - 05.09.29	1 920 000	EUR	1 780 539	1 839 955	0,08
AT&T Inc. 2.45% 15 - 15.03.35	1 870 000	EUR	1 556 358	1 662 767	0,07
AT&T Inc. 2.60% 14 - 17.12.29	1 080 000	EUR	1 002 499	1 041 250	0,04
AT&T Inc. 2.60% 20 - 19.05.38	570 000	EUR	461 008	488 980	0,02
AT&T Inc. 2.60% 20 - 19.05.38	200 000	EUR	155 716	171 572	0,01
AT&T Inc. 3.15% 17 - 04.09.36	2 620 000	EUR	2 296 488	2 440 137	0,10
AT&T Inc. 3.375% 14 - 15.03.34	670 000	EUR	616 830	655 823	0,03
AT&T Inc. 3.50% 13 - 17.12.25	1 440 000	EUR	1 443 996	1 443 269	0,06
AT&T Inc. 3.55% 12 - 17.12.32	2 020 000	EUR	1 929 276	2 025 838	0,08
AT&T Inc. 3.55% 23 - 18.11.25	1 430 000	EUR	1 427 810	1 437 808	0,06
AT&T Inc. 3.95% 23 - 30.04.31	1 460 000	EUR	1 462 960	1 514 589	0,06
AT&T Inc. 4.30% 23 - 18.11.34	1 860 000	EUR	1 885 738	1 965 332	0,08
Avery Dennison Corp. 1.25% 17 - 03.03.25	780 000	EUR	765 260	756 811	0,03
Bank of America Corp. FRN 19 - 08.08.29	1 206 000	EUR	1 102 726	1 058 675	0,04
Bank of America Corp. FRN 21 - 24.08.28	1 120 000	EUR	1 032 735	1 009 344	0,04
Bank of America Corp. FRN 20 - 26.10.31	1 630 000	EUR	1 421 055	1 335 035	0,06
Bank of America Corp. FRN 21 - 22.03.31	1 800 000	EUR	1 603 095	1 504 134	0,06
Bank of America Corp. FRN 19 - 09.05.26	1 510 000	EUR	1 462 486	1 451 201	0,06
Bank of America Corp. FRN 21 - 24.05.32	1 800 000	EUR	1 658 925	1 499 940	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Bank of America Corp. 1.375% 15 - 26.03.25	900 000	EUR	888 905	877 572	0,04
Bank of America Corp. FRN 19 - 09.05.30	1 340 000	EUR	1 248 996	1 198 094	0,05
Bank of America Corp. FRN 18 - 25.04.28	1 330 000	EUR	1 286 597	1 256 916	0,05
Bank of America Corp. FRN 17 - 04.05.27	1 800 000	EUR	1 761 862	1 729 314	0,07
Bank of America Corp. FRN 22 - 27.10.26	2 170 000	EUR	2 141 115	2 106 831	0,09
Bank of America Corp. FRN 22 - 27.04.33	2 030 000	EUR	1 952 963	1 904 668	0,08
Bank of America Corp. FRN 20 - 31.03.29	1 805 000	EUR	1 902 548	1 817 166	0,08
Bank of America Corp. 4.134% 23 - 12.06.28	1 170 000	EUR	1 166 179	1 206 586	0,05
Baxter International Inc. 1.30% 17 - 30.05.25	940 000	EUR	918 655	908 322	0,04
Baxter International Inc. 1.30% 19 - 15.05.29	1 080 000	EUR	1 003 301	969 365	0,04
Becton Dickinson & Co. 0.034% 21 - 13.08.25	720 000	EUR	696 324	681 818	0,03
Becton Dickinson & Co. 1.90% 16 - 15.12.26	810 000	EUR	795 803	782 606	0,03
Berry Global Inc. 1.00% 20 - 15.01.25	860 000	EUR	832 319	833 607	0,04
Berry Global Inc. 1.50% 20 - 15.01.27	500 000	EUR	457 401	467 905	0,02
BlackRock Inc. 1.25% 15 - 06.05.25	780 000	EUR	768 087	760 835	0,03
BMW US Capital LLC 1.00% 15 - 20.04.27	785 000	EUR	764 168	740 514	0,03
Booking Holdings Inc. 0.10% 21 - 08.03.25	1 470 000	EUR	1 434 060	1 412 670	0,06
Booking Holdings Inc. 0.50% 21 - 08.03.28	1 220 000	EUR	1 110 554	1 106 174	0,05
Booking Holdings Inc. 1.80% 15 - 03.03.27	1 530 000	EUR	1 500 686	1 472 962	0,06
Booking Holdings Inc. 3.625% 23 - 12.11.28	740 000	EUR	741 345	760 335	0,03
Booking Holdings Inc. 4.00% 22 - 15.11.26	1 000 000	EUR	1 010 604	1 027 330	0,04
Booking Holdings Inc. 4.125% 23 - 12.05.33	1 730 000	EUR	1 740 182	1 846 135	0,08
Booking Holdings Inc. 4.25% 22 - 15.05.29	1 070 000	EUR	1 096 315	1 132 338	0,05
Booking Holdings Inc. 4.50% 22 - 15.11.31	1 400 000	EUR	1 452 281	1 523 942	0,06
Booking Holdings Inc. 4.75% 22 - 15.11.34	1 490 000	EUR	1 574 491	1 680 049	0,07
BorgWarner Inc. 1.00% 21 - 19.05.31	1 470 000	EUR	1 228 916	1 209 692	0,05
Boston Scientific Corp. 0.625% 19 - 01.12.27	1 400 000	EUR	1 263 684	1 279 348	0,05
Bristol-Myers Squibb Co. 1.00% 15 - 15.05.25	800 000	EUR	793 841	776 400	0,03
Bristol-Myers Squibb Co. 1.75% 15 - 15.05.35	850 000	EUR	757 817	751 128	0,03
Capital One Financial Corp. 1.65% 19 - 12.06.29	600 000	EUR	504 647	528 132	0,02
Carrier Global Corp. 4.125% 23 - 29.05.28	1 100 000	EUR	1 110 661	1 133 572	0,05
Carrier Global Corp. 4.375% 23 - 29.05.25	1 100 000	EUR	1 103 651	1 109 537	0,05
Carrier Global Corp. 4.50% 23 - 29.11.32	1 200 000	EUR	1 228 316	1 283 880	0,05
Caterpillar Financial Services Corp. 3.742% 23 - 04.09.26	1 200 000	EUR	1 200 915	1 223 964	0,05
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.06.27	700 000	EUR	666 282	655 529	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.12.29	1 050 000	EUR	942 861	929 890	0,04
Chubb INA Holdings Inc. 1.40% 19 - 15.06.31	600 000	EUR	608 521	528 432	0,02
Chubb INA Holdings Inc. 1.55% 18 - 15.03.28	1 010 000	EUR	962 209	953 046	0,04
Chubb INA Holdings Inc. 2.50% 18 - 15.03.38	1 010 000	EUR	948 977	885 497	0,04
Citigroup Inc. FRN 19 - 08.10.27	1 900 000	EUR	1 789 375	1 755 790	0,07
Citigroup Inc. 1.25% 19 - 10.04.29	1 619 000	EUR	1 490 551	1 455 578	0,06
Citigroup Inc. FRN 20 - 06.07.26	2 070 000	EUR	2 026 644	1 993 182	0,08
Citigroup Inc. 1.50% 16 - 26.10.28	1 236 000	EUR	1 147 807	1 138 232	0,05
Citigroup Inc. FRN 18 - 24.07.26	2 075 000	EUR	2 044 111	2 003 454	0,08
Citigroup Inc. 1.625% 18 - 21.03.28	810 000	EUR	782 485	759 796	0,03
Citigroup Inc. 1.75% 15 - 28.01.25	1 382 000	EUR	1 377 371	1 352 094	0,06
Citigroup Inc. 2.125% 14 - 10.09.26	1 028 000	EUR	1 037 717	989 738	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Citigroup Inc. FRN 22 - 22.09.28	1 080 000	EUR	1 068 083	1 095 800	0,05
Citigroup Inc. FRN 22 - 22.09.33	1 170 000	EUR	1 149 530	1 206 937	0,05
Citigroup Inc. FRN 05 - 25.02.30	464 000	EUR	488 261	463 323	0,02
Comcast Corp. Zero Coupon 21 - 14.09.26	1 890 000	EUR	1 727 731	1 743 241	0,07
Comcast Corp. 0.25% 20 - 20.05.27	1 250 000	EUR	1 122 761	1 145 962	0,05
Comcast Corp. 0.25% 21 - 14.09.29	820 000	EUR	681 501	708 939	0,03
Comcast Corp. 0.75% 20 - 20.02.32	2 100 000	EUR	1 697 869	1 765 806	0,07
Comcast Corp. 1.25% 20 - 20.02.40	1 150 000	EUR	819 760	869 952	0,04
Computershare US Inc. 1.125% 21 - 07.10.31	550 000	EUR	452 454	426 993	0,02
Corning Inc. 3.875% 23 - 15.05.26	400 000	EUR	397 676	404 388	0,02
Corning Inc. 4.125% 23 - 15.05.31	750 000	EUR	745 320	784 747	0,03
Danaher Corp. 2.10% 20 - 30.09.26	1 190 000	EUR	1 180 984	1 163 463	0,05
Danaher Corp. 2.50% 20 - 30.03.30	1 140 000	EUR	1 142 011	1 106 051	0,05
Digital Euro Finco LLC 1.125% 19 - 09.04.28	510 000	EUR	454 150	461 550	0,02
Digital Euro Finco LLC 2.50% 19 - 16.01.26	1 300 000	EUR	1 326 637	1 265 732	0,05
Discovery Communications LLC 1.90% 15 - 19.03.27	835 000	EUR	801 584	794 619	0,03
Dover Corp. 0.75% 19 - 04.11.27	780 000	EUR	728 549	713 996	0,03
Dover Corp. 1.25% 16 - 09.11.26	878 000	EUR	842 568	836 392	0,04
DXC Technology Co. 1.75% 18 - 15.01.26	1 010 000	EUR	972 967	975 014	0,04
Eli Lilly & Co. 0.50% 21 - 14.09.33	810 000	EUR	665 016	659 615	0,03
Eli Lilly & Co. 0.625% 19 - 01.11.31	880 000	EUR	765 789	754 301	0,03
Eli Lilly & Co. 1.125% 21 - 14.09.51	750 000	EUR	513 917	488 100	0,02
Eli Lilly & Co. 1.375% 21 - 14.09.61	920 000	EUR	645 160	575 635	0,02
Eli Lilly & Co. 1.625% 15 - 02.06.26	1 020 000	EUR	1 009 175	991 032	0,04
Eli Lilly & Co. 1.70% 19 - 01.11.49	1 580 000	EUR	1 510 706	1 193 058	0,05
Eli Lilly & Co. 2.125% 15 - 03.06.30	1 080 000	EUR	1 084 242	1 047 373	0,04
Equinix Inc. 0.25% 21 - 15.03.27	700 000	EUR	645 207	637 385	0,03
Equinix Inc. 1.00% 21 - 15.03.33	1 000 000	EUR	796 746	808 590	0,03
Equitable Financial Life Global Funding 0.60% 21 - 16.06.28	630 000	EUR	565 414	560 196	0,02
FedEx Corp. 0.45% 19 - 05.08.25	880 000	EUR	853 830	841 641	0,04
FedEx Corp. 0.45% 21 - 04.05.29	880 000	EUR	746 606	764 861	0,03
FedEx Corp. 0.95% 21 - 04.05.33	950 000	EUR	755 752	749 759	0,03
FedEx Corp. 1.30% 19 - 05.08.31	680 000	EUR	615 224	600 522	0,03
FedEx Corp. 1.625% 16 - 11.01.27	1 830 000	EUR	1 779 205	1 753 030	0,07
Fidelity National Information Services Inc. 0.625% 19 - 03.12.25	970 000	EUR	922 799	921 859	0,04
Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 19 - 03.12.28	910 000	EUR	821 462	821 111	0,03
Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 19 - 21.05.27	1 830 000	EUR	1 759 698	1 732 003	0,07
Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 19 - 21.05.30	1 370 000	EUR	1 347 615	1 270 648	0,05
Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 19 - 21.05.39	770 000	EUR	674 279	675 221	0,03
Fiserv Inc. 1.125% 19 - 01.07.27	680 000	EUR	649 184	637 718	0,03
Fiserv Inc. 1.625% 19 - 01.07.30	610 000	EUR	555 905	551 391	0,02
Fiserv Inc. 4.50% 23 - 24.05.31	1 250 000	EUR	1 262 059	1 326 412	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Electric Co. 0.875% 17 - 17.05.25	930 000	EUR	897 314	898 231	0,04
General Electric Co. 1.50% 17 - 17.05.29	1 600 000	EUR	1 445 137	1 481 184	0,06
General Electric Co. 1.875% 15 - 28.05.27	820 000	EUR	774 214	783 403	0,03
General Electric Co. 2.125% 17 - 17.05.37	1 050 000	EUR	844 952	918 592	0,04
General Electric Co. 4.125% 05 - 19.09.35	900 000	EUR	893 156	962 991	0,04
General Mills Inc. 0.125% 21 - 15.11.25	880 000	EUR	828 501	831 054	0,03
General Mills Inc. 0.45% 20 - 15.01.26	730 000	EUR	708 439	688 726	0,03
General Mills Inc. 1.50% 15 - 27.04.27	500 000	EUR	495 553	472 800	0,02
General Mills Inc. 3.907% 23 - 13.04.29	1 230 000	EUR	1 238 911	1 269 065	0,05
General Motors Financial Co. Inc. 0.60% 21 - 20.05.27	1 310 000	EUR	1 169 403	1 197 157	0,05
General Motors Financial Co. Inc. 0.65% 21 - 07.09.28	800 000	EUR	678 814	703 712	0,03
General Motors Financial Co. Inc. 0.85% 20 - 26.02.26	1 010 000	EUR	947 199	958 682	0,04
General Motors Financial Co. Inc. 1.00% 22 - 24.02.25	810 000	EUR	784 651	785 643	0,03
General Motors Financial Co. Inc. 1.694% 18 - 26.03.25	780 000	EUR	759 719	760 352	0,03
General Motors Financial Co. Inc. 4.30% 23 - 15.02.29	990 000	EUR	973 518	1 019 947	0,04
General Motors Financial Co. Inc. 4.50% 23 - 22.11.27	900 000	EUR	900 095	932 679	0,04
Global Payments Inc. 4.875% 23 - 17.03.31	1 110 000	EUR	1 105 679	1 164 645	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 0.25% 21 - 26.01.28	2 120 000	EUR	1 934 487	1 877 366	0,08
Goldman Sachs Group Inc. 0.75% 21 - 23.03.32	1 572 000	EUR	1 329 034	1 256 059	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 20 - 21.01.30	1 526 000	EUR	1 346 636	1 313 092	0,06
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 21 - 09.05.29	1 050 000	EUR	945 530	912 880	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 21 - 18.03.33	1 440 000	EUR	1 252 194	1 143 850	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 1.25% 16 - 01.05.25	1 536 000	EUR	1 511 693	1 487 892	0,06
Goldman Sachs Group Inc. 1.25% 22 - 07.02.29	1 440 000	EUR	1 303 325	1 288 469	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 1.625% 16 - 27.07.26	2 484 000	EUR	2 447 783	2 387 745	0,10
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 22.03.28	964 000	EUR	939 128	919 984	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 01.11.28	1 704 000	EUR	1 667 766	1 610 962	0,07
Goldman Sachs Group Inc. 2.875% 14 - 03.06.26	861 000	EUR	865 509	854 663	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 3.00% 16 - 12.02.31	1 073 000	EUR	1 086 008	1 055 811	0,04
Goldman Sachs Group Inc. 3.375% 20 - 27.03.25	2 343 000	EUR	2 360 519	2 338 220	0,10
Goldman Sachs Group Inc. 4.00% 22 - 21.09.29	1 170 000	EUR	1 152 706	1 207 323	0,05
Harley-Davidson Financial Services Inc. 5.125% 23 - 05.04.26	1 050 000	EUR	1 057 618	1 083 211	0,05
IHG Finance LLC 4.375% 23 - 28.11.29	900 000	EUR	940 212	932 976	0,04
Illinois Tool Works Inc. 0.625% 19 - 05.12.27	810 000	EUR	746 804	745 184	0,03
Illinois Tool Works Inc. 1.00% 19 - 05.06.31	730 000	EUR	666 989	642 458	0,03
Illinois Tool Works Inc. 2.125% 15 - 22.05.30	600 000	EUR	591 301	574 890	0,02
Illinois Tool Works Inc. 3.00% 14 - 19.05.34	790 000	EUR	803 547	784 494	0,03
International Business Machines Corp. 0.30% 20 - 11.02.28	1 772 000	EUR	1 649 520	1 596 324	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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. 0.65% 20 - 11.02.32	2 290 000	EUR	2 027 873	1 893 349	0,08
International Business Machines Corp. 0.875% 19 - 31.01.25	1 470 000	EUR	1 452 323	1 427 532	0,06
International Business Machines Corp. 0.875% 22 - 09.02.30	1 430 000	EUR	1 276 699	1 265 007	0,05
International Business Machines Corp. 0.95% 17 - 23.05.25	1 457 000	EUR	1 435 732	1 408 759	0,06
International Business Machines Corp. 1.20% 20 - 11.02.40	1 282 000	EUR	992 835	931 181	0,04
International Business Machines Corp. 1.25% 19 - 29.01.27	1 500 000	EUR	1 457 621	1 425 075	0,06
International Business Machines Corp. 1.25% 22 - 09.02.34	1 400 000	EUR	1 213 244	1 170 988	0,05
International Business Machines Corp. 1.50% 17 - 23.05.29	1 550 000	EUR	1 517 552	1 443 143	0,06
International Business Machines Corp. 1.75% 16 - 07.03.28	730 000	EUR	726 427	699 778	0,03
International Business Machines Corp. 1.75% 19 - 31.01.31	1 830 000	EUR	1 774 829	1 679 007	0,07
International Business Machines Corp. 2.875% 13 - 07.11.25	1 400 000	EUR	1 384 471	1 391 502	0,06
International Business Machines Corp. 3.375% 23 - 06.02.27	1 500 000	EUR	1 484 748	1 518 030	0,06
International Business Machines Corp. 3.625% 23 - 06.02.31	1 890 000	EUR	1 893 688	1 948 968	0,08
International Business Machines Corp. 3.75% 23 - 06.02.35	1 500 000	EUR	1 501 203	1 565 040	0,07
International Business Machines Corp. 4.00% 23 - 06.02.43	1 450 000	EUR	1 442 957	1 507 681	0,06
International Flavors & Fragrances Inc. 1.80% 18 - 25.09.26	990 000	EUR	977 188	940 411	0,04
International Flavors & Fragrances Inc. 1.80% 18 - 25.09.26	100 000	EUR	93 433	94 991	0,00
Johnson & Johnson 1.15% 16 - 20.11.28	1 080 000	EUR	1 041 360	1 016 291	0,04
Johnson & Johnson 1.65% 16 - 20.05.35	2 150 000	EUR	2 012 357	1 929 603	0,08
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 24.02.28	1 540 000	EUR	1 451 237	1 403 002	0,06
JPMorgan Chase & Co. FRN 21 - 17.02.33	1 720 000	EUR	1 508 068	1 383 086	0,06
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 25.07.31	1 700 000	EUR	1 586 858	1 450 542	0,06
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 04.11.32	2 010 000	EUR	1 801 496	1 682 068	0,07
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 11.03.27	2 340 000	EUR	2 294 981	2 223 047	0,09
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 15 - 27.01.25	1 700 000	EUR	1 696 056	1 658 231	0,07
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 16 - 29.10.26	1 790 000	EUR	1 752 766	1 715 053	0,07
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 18.05.28	2 390 000	EUR	2 342 991	2 257 618	0,09
JPMorgan Chase & Co. FRN 18 - 12.06.29	1 230 000	EUR	1 195 897	1 150 382	0,05
JPMorgan Chase & Co. FRN 22 - 23.03.30	2 870 000	EUR	2 724 971	2 673 290	0,11
JPMorgan Chase & Co. 2.875% 13 - 24.05.28	1 140 000	EUR	1 161 722	1 122 638	0,05
JPMorgan Chase & Co. 3.00% 14 - 19.02.26	1 140 000	EUR	1 174 652	1 132 123	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
JPMorgan Chase & Co. FRN 23 - 13.11.31	2 350 000	EUR	2 384 260	2 477 135	0,10
Kellanova 0.50% 21 - 20.05.29	370 000	EUR	318 474	320 483	0,01
Kellanova 1.25% 15 - 10.03.25	940 000	EUR	927 527	916 256	0,04
Kraft Heinz Foods Co. 2.25% 16 - 25.05.28	1 930 000	EUR	1 863 029	1 865 441	0,08
Liberty Mutual Group Inc. 2.75% 16 - 04.05.26	930 000	EUR	907 476	914 980	0,04
Liberty Mutual Group Inc. 4.625% 22 - 02.12.30	600 000	EUR	601 670	628 650	0,03
Linde Inc. 1.625% 14 - 01.12.25	790 000	EUR	773 319	767 872	0,03
ManpowerGroup Inc. 1.75% 18 - 22.06.26	700 000	EUR	701 400	677 131	0,03
ManpowerGroup Inc. 3.50% 22 - 30.06.27	720 000	EUR	712 752	720 886	0,03
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.979% 19 - 21.03.30	540 000	EUR	514 914	508 826	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.349% 19 - 21.09.26	840 000	EUR	804 448	804 317	0,03
MassMutual Global Funding II 3.75% 23 - 19.01.30	550 000	EUR	535 342	562 293	0,02
Mastercard Inc. 1.00% 22 - 22.02.29	960 000	EUR	899 666	881 818	0,04
Mastercard Inc. 2.10% 15 - 01.12.27	1 180 000	EUR	1 193 845	1 148 459	0,05
Mastercard Inc. 2.10% 15 - 01.12.27	200 000	EUR	190 464	194 654	0,01
McDonald's Corp. 0.25% 21 - 04.10.28	810 000	EUR	740 566	714 193	0,03
McDonald's Corp. 0.875% 21 - 04.10.33	660 000	EUR	571 714	531 940	0,02
McDonald's Corp. 0.90% 19 - 15.06.26	800 000	EUR	767 730	761 024	0,03
McDonald's Corp. 1.50% 17 - 28.11.29	800 000	EUR	753 909	731 600	0,03
McDonald's Corp. 1.60% 19 - 15.03.31	700 000	EUR	630 510	629 377	0,03
McDonald's Corp. 1.75% 16 - 03.05.28	1 200 000	EUR	1 165 018	1 139 208	0,05
McDonald's Corp. 1.875% 15 - 26.05.27	900 000	EUR	909 933	865 080	0,04
McDonald's Corp. 2.375% 22 - 31.05.29	1 100 000	EUR	1 057 292	1 066 483	0,04
McDonald's Corp. 2.625% 14 - 11.06.29	400 000	EUR	397 112	392 408	0,02
McDonald's Corp. 2.875% 13 - 17.12.25	400 000	EUR	409 616	399 628	0,02
McDonald's Corp. 3.00% 22 - 31.05.34	950 000	EUR	903 515	921 604	0,04
McDonald's Corp. 3.625% 23 - 28.11.27	800 000	EUR	802 942	817 048	0,03
McDonald's Corp. 3.875% 23 - 20.02.31	1 000 000	EUR	1 007 321	1 038 780	0,04
McDonald's Corp. 4.00% 23 - 07.03.30	620 000	EUR	630 743	649 239	0,03
McDonald's Corp. 4.125% 23 - 28.11.35	1 100 000	EUR	1 098 339	1 159 312	0,05
McDonald's Corp. 4.25% 23 - 07.03.35	850 000	EUR	870 021	913 121	0,04
McKesson Corp. 1.50% 17 - 17.11.25	1 140 000	EUR	1 105 419	1 104 341	0,05
McKesson Corp. 1.625% 18 - 30.10.26	590 000	EUR	584 301	568 117	0,02
Merck & Co. Inc. 1.375% 16 - 02.11.36	100 000	EUR	73 086	82 883	0,00
Merck & Co. Inc. 1.375% 16 - 02.11.36	600 000	EUR	512 046	497 298	0,02
Merck & Co. Inc. 1.875% 14 - 15.10.26	1 530 000	EUR	1 537 453	1 488 675	0,06
Merck & Co. Inc. 2.50% 14 - 15.10.34	750 000	EUR	728 765	726 195	0,03
Metropolitan Life Global Funding I 0.50% 21 - 25.05.29	620 000	EUR	568 368	539 425	0,02
Metropolitan Life Global Funding I 0.55% 20 - 16.06.27	660 000	EUR	622 371	605 946	0,03
Metropolitan Life Global Funding I 1.75% 22 - 25.05.25	480 000	EUR	472 785	468 595	0,02
Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 22 - 05.12.30	950 000	EUR	958 466	975 108	0,04
Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 23 - 07.12.31	600 000	EUR	621 726	617 670	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Metropolitan Life Global Funding I 4.00% 23 - 05.04.28	640 000	EUR	641 543	660 582	0,03
Microsoft Corp. 2.625% 13 - 02.05.33	680 000	EUR	717 807	686 331	0,03
Microsoft Corp. 3.125% 13 - 06.12.28	2 780 000	EUR	2 964 640	2 863 511	0,12
MMS USA Holdings Inc. 0.625% 19 - 13.06.25	1 200 000	EUR	1 171 427	1 149 816	0,05
MMS USA Holdings Inc. 1.25% 19 - 13.06.28	1 200 000	EUR	1 126 336	1 108 428	0,05
MMS USA Holdings Inc. 1.75% 19 - 13.06.31	1 100 000	EUR	1 042 207	995 456	0,04
Moody's Corp. 0.95% 19 - 25.02.30	1 060 000	EUR	931 573	941 004	0,04
Moody's Corp. 1.75% 15 - 09.03.27	690 000	EUR	672 163	664 787	0,03
Morgan Stanley FRN 21 - 29.10.27	2 050 000	EUR	1 942 990	1 882 433	0,08
Morgan Stanley FRN 20 - 26.10.29	2 120 000	EUR	1 882 237	1 830 238	0,08
Morgan Stanley FRN 21 - 07.02.31	1 850 000	EUR	1 707 965	1 532 133	0,06
Morgan Stanley FRN 21 - 29.04.33	2 150 000	EUR	1 948 282	1 745 305	0,07
Morgan Stanley FRN 17 - 23.10.26	1 340 000	EUR	1 307 265	1 286 038	0,05
Morgan Stanley 1.375% 16 - 27.10.26	1 700 000	EUR	1 654 690	1 614 779	0,07
Morgan Stanley 1.75% 15 - 30.01.25	1 700 000	EUR	1 695 224	1 665 286	0,07
Morgan Stanley 1.875% 17 - 27.04.27	2 490 000	EUR	2 475 869	2 375 883	0,10
Morgan Stanley FRN 22 - 08.05.26	1 750 000	EUR	1 724 400	1 710 240	0,07
Morgan Stanley FRN 22 - 07.05.32	1 610 000	EUR	1 544 496	1 523 736	0,06
Morgan Stanley FRN 23 - 02.03.29	2 270 000	EUR	2 307 329	2 356 850	0,10
Morgan Stanley FRN 22 - 25.10.28	1 230 000	EUR	1 253 784	1 287 244	0,05
Morgan Stanley FRN 22 - 25.01.34	2 100 000	EUR	2 176 562	2 306 472	0,10
Nasdaq Inc. 0.875% 20 - 13.02.30	850 000	EUR	769 721	737 860	0,03
Nasdaq Inc. 0.90% 21 - 30.07.33	690 000	EUR	567 469	546 901	0,02
Nasdaq Inc. 1.75% 19 - 28.03.29	670 000	EUR	659 200	621 740	0,03
Nasdaq Inc. 4.50% 23 - 15.02.32	850 000	EUR	854 556	909 908	0,04
New York Life Global Funding 0.25% 20 - 23.01.27	1 040 000	EUR	937 127	962 437	0,04
New York Life Global Funding 0.25% 21 - 04.10.28	780 000	EUR	659 950	690 690	0,03
New York Life Global Funding 3.625% 23 - 09.01.30	640 000	EUR	630 917	658 675	0,03
Oracle Corp. 3.125% 13 - 10.07.25	1 120 000	EUR	1 132 959	1 117 715	0,05
Parker-Hannifin Corp. 1.125% 17 - 01.03.25	990 000	EUR	975 483	960 033	0,04
Pfizer Inc. 1.00% 17 - 06.03.27	1 000 000	EUR	963 058	947 120	0,04
PPG Industries Inc. 0.875% 16 - 03.11.25	940 000	EUR	914 511	898 217	0,04
PPG Industries Inc. 1.40% 15 - 13.03.27	740 000	EUR	715 197	697 894	0,03
PPG Industries Inc. 1.875% 22 - 01.06.25	590 000	EUR	577 474	576 389	0,02
PPG Industries Inc. 2.75% 22 - 01.06.29	960 000	EUR	921 094	937 862	0,04
Prologis Euro Finance LLC 0.25% 19 - 10.09.27	640 000	EUR	601 298	575 930	0,02
Prologis Euro Finance LLC 0.375% 20 - 06.02.28	690 000	EUR	634 193	615 142	0,03
Prologis Euro Finance LLC 0.50% 21 - 16.02.32	910 000	EUR	775 662	712 230	0,03
Prologis Euro Finance LLC 0.625% 19 - 10.09.31	900 000	EUR	745 948	735 102	0,03
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 20 - 06.02.35	700 000	EUR	583 901	521 815	0,02
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 21 - 16.02.41	540 000	EUR	383 605	340 022	0,01
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 22 - 08.02.29	670 000	EUR	594 229	595 061	0,03
Prologis Euro Finance LLC 1.50% 19 - 10.09.49	600 000	EUR	412 286	366 114	0,02
Prologis Euro Finance LLC 1.50% 22 - 08.02.34	870 000	EUR	751 888	709 720	0,03
Prologis Euro Finance LLC 1.875% 18 - 05.01.29	700 000	EUR	677 714	651 147	0,03
Prologis Euro Finance LLC 3.875% 23 - 31.01.30	810 000	EUR	801 960	824 143	0,03
Prologis Euro Finance LLC 4.25% 23 - 31.01.43	750 000	EUR	732 666	756 068	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.625% 23 - 23.05.33	900 000	EUR	903 537	960 372	0,04
Prologis LP 3.00% 14 - 02.06.26	530 000	EUR	533 769	523 640	0,02
Public Storage 0.50% 21 - 09.09.30	900 000	EUR	710 238	743 769	0,03
Public Storage 0.875% 20 - 24.01.32	450 000	EUR	349 379	372 056	0,02
PVH Corp. 3.125% 17 - 15.12.27	840 000	EUR	810 484	822 587	0,03
RELX Capital Inc. 1.30% 15 - 12.05.25	880 000	EUR	867 434	855 043	0,04
Revvity Inc. 1.875% 16 - 19.07.26	680 000	EUR	656 922	655 078	0,03
Stryker Corp. 0.75% 19 - 01.03.29	1 040 000	EUR	905 339	924 789	0,04
Stryker Corp. 1.00% 19 - 03.12.31	1 100 000	EUR	892 552	930 215	0,04
Stryker Corp. 2.125% 18 - 30.11.27	1 180 000	EUR	1 136 815	1 141 992	0,05
Stryker Corp. 2.625% 18 - 30.11.30	1 030 000	EUR	962 118	996 958	0,04
Stryker Corp. 3.375% 23 - 11.12.28	850 000	EUR	858 875	862 988	0,04
Tapestry Inc. 5.35% 23 - 27.11.25	700 000	EUR	708 109	714 266	0,03
Tapestry Inc. 5.375% 23 - 27.11.27	800 000	EUR	811 015	828 696	0,03
Tapestry Inc. 5.875% 23 - 27.11.31	700 000	EUR	708 784	735 665	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.125% 19 - 01.03.25	1 245 000	EUR	1 218 748	1 197 229	0,05
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.50% 19 - 01.03.28	1 140 000	EUR	1 055 556	1 036 340	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.875% 19 - 01.10.31	1 300 000	EUR	1 177 746	1 108 796	0,05
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.375% 16 - 12.09.28	940 000	EUR	910 530	878 233	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.40% 17 - 23.01.26	1 110 000	EUR	1 078 581	1 071 061	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.45% 17 - 16.03.27	650 000	EUR	626 818	621 069	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.50% 19 - 01.10.39	1 280 000	EUR	1 058 949	976 205	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.75% 20 - 15.04.27	840 000	EUR	841 322	810 163	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.875% 19 - 01.10.49	1 400 000	EUR	1 181 516	1 000 874	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.875% 19 - 01.10.49	100 000	EUR	82 604	71 491	0,00
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.95% 17 - 24.07.29	1 100 000	EUR	1 073 600	1 043 900	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.00% 14 - 15.04.25	907 000	EUR	901 769	888 461	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.375% 20 - 15.04.32	840 000	EUR	843 186	796 404	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.875% 17 - 24.07.37	1 100 000	EUR	1 139 880	1 041 304	0,04
Thermo Fisher Scientific Inc. 3.20% 22 - 21.01.26	660 000	EUR	656 206	661 432	0,03
Thermo Fisher Scientific Inc. 3.65% 22 - 21.11.34	1 100 000	EUR	1 088 580	1 144 968	0,05
United Parcel Service Inc. 1.00% 16 - 15.11.28	680 000	EUR	629 549	626 232	0,03
United Parcel Service Inc. 1.50% 17 - 15.11.32	701 000	EUR	638 694	615 506	0,03
United Parcel Service Inc. 1.625% 15 - 15.11.25	1 100 000	EUR	1 095 188	1 070 773	0,04
Verizon Communications Inc. 0.375% 21 - 22.03.29	1 500 000	EUR	1 310 261	1 303 950	0,05
Verizon Communications Inc. 0.75% 21 - 22.03.32	1 470 000	EUR	1 270 844	1 205 503	0,05
Verizon Communications Inc. 0.875% 16 - 02.04.25	1 450 000	EUR	1 430 244	1 404 542	0,06
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 08.04.27	1 930 000	EUR	1 867 630	1 803 932	0,08
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 19.03.32	1 160 000	EUR	1 015 995	959 540	0,04
Verizon Communications Inc. 1.125% 21 - 19.09.35	1 060 000	EUR	881 319	819 104	0,03
Verizon Communications Inc. 1.25% 19 - 08.04.30	1 740 000	EUR	1 621 062	1 549 905	0,06
Verizon Communications Inc. 1.30% 20 - 18.05.33	2 060 000	EUR	1 828 465	1 719 544	0,07
Verizon Communications Inc. 1.375% 16 - 02.11.28	1 700 000	EUR	1 666 128	1 575 169	0,07
Verizon Communications Inc. 1.375% 17 - 27.10.26	1 930 000	EUR	1 880 649	1 846 508	0,08
Verizon Communications Inc. 1.50% 19 - 19.09.39	650 000	EUR	527 981	486 740	0,02
Verizon Communications Inc. 1.85% 20 - 18.05.40	1 170 000	EUR	991 666	917 175	0,04
Verizon Communications Inc. 1.875% 17 - 26.10.29	980 000	EUR	944 237	914 311	0,04
Verizon Communications Inc. 2.625% 14 - 01.12.31	1 400 000	EUR	1 423 415	1 337 378	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Verizon Communications Inc. 2.875% 17 - 15.01.38	2 260 000	EUR	2 262 013	2 086 929	0,09
Verizon Communications Inc. 3.25% 14 - 17.02.26	1 880 000	EUR	1 939 729	1 886 317	0,08
Verizon Communications Inc. 4.25% 22 - 31.10.30	1 900 000	EUR	1 929 994	2 014 114	0,08
Verizon Communications Inc. 4.75% 22 - 31.10.34	1 800 000	EUR	1 872 065	1 993 896	0,08
VF Corp. 0.25% 20 - 25.02.28	566 000	EUR	511 087	475 700	0,02
VF Corp. 0.625% 20 - 25.02.32	700 000	EUR	597 868	490 616	0,02
VF Corp. 4.125% 23 - 07.03.26	830 000	EUR	824 020	821 086	0,03
VF Corp. 4.25% 23 - 07.03.29	810 000	EUR	806 979	777 705	0,03
Visa Inc. 1.50% 22 - 15.06.26	2 050 000	EUR	1 998 328	1 980 874	0,08
Visa Inc. 2.00% 22 - 15.06.29	1 330 000	EUR	1 283 422	1 278 861	0,05
Visa Inc. 2.375% 22 - 15.06.34	920 000	EUR	876 069	878 904	0,04
Walmart Inc. 2.55% 14 - 08.04.26	820 000	EUR	825 167	813 383	0,03
Walmart Inc. 4.875% 09 - 21.09.29	1 550 000	EUR	1 822 215	1 724 778	0,07
Westlake Corp. 1.625% 19 - 17.07.29	1 000 000	EUR	850 190	897 590	0,04
Zimmer Biomet Holdings Inc. 1.164% 19 - 15.11.27	700 000	EUR	628 802	648 725	0,03
Zimmer Biomet Holdings Inc. 2.425% 16 - 13.12.26	800 000	EUR	765 881	784 648	0,03
			403 271 329	398 304 423	16,63
Total - Obligations			2 383 160 734	2 365 488 428	98,78
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	25	EUR	250 546	251 240	0,01
			250 546	251 240	0,01
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			250 546	251 240	0,01
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			2 383 411 280	2 365 739 668	98,79
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			2 383 411 280	2 365 739 668	98,79
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				2 393 154 526	99,94

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Region de Bruxelles-Capitale 1.50% 23 - 22.06.70	1 500 000	EUR	693 387	831 450	7,23
			693 387	831 450	7,23
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.24	160 000	EUR	158 213	158 184	1,38
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.25	200 000	EUR	191 028	192 646	1,68
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.28	230 000	EUR	201 342	208 591	1,81
			550 583	559 421	4,87
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 97 - 04.07.24	150 000	EUR	147 390	147 289	1,28
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 05 - 04.01.37	240 000	EUR	169 501	179 117	1,56
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.125% 22 - 31.03.37	280 000	EUR	214 665	230 292	2,00
			531 556	556 698	4,84
Italie					
Italy Zero Coupon 00 - 01.05.31	310 000	EUR	231 508	242 786	2,11
Italy 144A 4.00% 05 - 01.02.37	3 000 000	EUR	3 941 435	3 042 450	26,48
			4 172 943	3 285 236	28,59
Luxembourg					
Luxembourg 3.25% 23 - 02.03.43	2 060 000	EUR	1 967 603	2 182 302	18,99
			1 967 603	2 182 302	18,99
Supranationales					
European Union 0.30% 20 - 04.11.50	270 000	EUR	124 998	138 310	1,21
International Bank for Reconstruction & Development 0.125% 20 - 03.01.51	2 460 000	EUR	966 323	1 174 675	10,22
International Development Association 0.70% 22 - 17.01.42	3 168 000	EUR	1 923 952	2 154 937	18,75
			3 015 273	3 467 922	30,18
Royaume-Uni					
United Kingdom 0.25% 20 - 31.07.31	155 000	GBP	139 497	141 472	1,23
			139 497	141 472	1,23
Total - Obligations			11 070 842	11 024 501	95,93
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			11 070 842	11 024 501	95,93
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			11 070 842	11 024 501	95,93
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				11 169 001	97,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Grèce					
Greece 3.75% 17 - 30.01.28	2 002 000	EUR	2 105 904	2 098 016	0,23
Greece 3.90% 17 - 30.01.33	2 373 000	EUR	2 546 988	2 522 452	0,27
Greece 4.00% 17 - 30.01.37	1 888 000	EUR	2 016 195	1 996 164	0,22
Greece 4.20% 17 - 30.01.42	1 839 000	EUR	1 993 016	1 958 995	0,21
Greece 144A Zero Coupon 21 - 12.02.26	1 511 000	EUR	1 440 210	1 437 565	0,16
Greece 144A 0.75% 21 - 18.06.31	2 014 000	EUR	1 736 672	1 721 185	0,19
Greece 144A 1.50% 20 - 18.06.30	1 847 000	EUR	1 711 800	1 698 889	0,18
Greece 144A 1.75% 22 - 18.06.32	1 242 000	EUR	1 137 175	1 132 704	0,12
Greece 144A 1.875% 19 - 23.07.26	839 000	EUR	832 657	830 920	0,09
Greece 144A 1.875% 20 - 04.02.35	1 511 000	EUR	1 322 578	1 306 078	0,14
Greece 144A 1.875% 21 - 24.01.52	1 175 000	EUR	853 050	841 288	0,09
Greece 144A 2.00% 20 - 22.04.27	1 318 000	EUR	1 313 493	1 310 277	0,14
Greece 144A 3.375% 18 - 15.02.25	682 000	EUR	687 490	686 187	0,07
Greece 144A 3.875% 19 - 12.03.29	1 343 000	EUR	1 434 324	1 425 165	0,16
Greece 144A 3.875% 23 - 15.06.28	974 000	EUR	1 031 934	1 028 797	0,11
Greece 144A 4.25% 23 - 15.06.33	1 578 000	EUR	1 739 429	1 727 949	0,19
Greece 144A 4.375% 23 - 18.07.38	1 175 000	EUR	1 303 592	1 294 033	0,14
			25 206 507	25 016 664	2,71
Italie					
Italy Zero Coupon 21 - 01.04.26	7 059 000	EUR	6 806 385	6 627 307	0,72
Italy Zero Coupon 21 - 01.08.26	6 122 000	EUR	5 873 220	5 700 511	0,62
Italy 0.25% 21 - 15.03.28	6 285 000	EUR	5 874 131	5 629 018	0,61
Italy 0.35% 19 - 01.02.25	6 188 000	EUR	6 107 877	5 998 495	0,65
Italy 0.45% 21 - 15.02.29	5 112 000	EUR	4 662 307	4 489 887	0,49
Italy 0.50% 20 - 01.02.26	6 440 000	EUR	6 254 721	6 134 617	0,66
Italy 0.50% 21 - 15.07.28	5 371 000	EUR	5 125 018	4 819 452	0,52
Italy 0.85% 19 - 15.01.27	6 553 000	EUR	6 300 151	6 185 782	0,67
Italy 0.90% 20 - 01.04.31	8 094 000	EUR	7 383 668	6 841 743	0,74
Italy 0.95% 20 - 01.08.30	6 437 000	EUR	5 871 617	5 563 605	0,60
Italy 0.95% 20 - 15.09.27	7 151 000	EUR	6 900 713	6 680 178	0,72
Italy 0.95% 21 - 01.06.32	6 812 000	EUR	5 771 098	5 575 482	0,60
Italy 1.10% 22 - 01.04.27	4 712 000	EUR	4 532 360	4 462 594	0,48
Italy 1.20% 22 - 15.08.25	5 199 000	EUR	5 098 209	5 052 856	0,55
Italy 1.25% 16 - 01.12.26	6 677 000	EUR	6 517 472	6 394 680	0,69
Italy 1.35% 19 - 01.04.30	7 411 000	EUR	7 141 155	6 641 590	0,72
Italy 1.45% 18 - 15.05.25	5 311 000	EUR	5 249 327	5 198 067	0,56
Italy 1.45% 18 - 15.05.25	36 000	EUR	35 238	35 234	0,00
Italy 1.50% 15 - 01.06.25	7 236 000	EUR	7 180 402	7 080 380	0,77
Italy 1.60% 16 - 01.06.26	7 279 000	EUR	7 219 288	7 078 154	0,77
Italy 2.00% 15 - 01.12.25	7 141 000	EUR	7 130 050	7 025 801	0,76
Italy 2.00% 18 - 01.02.28	8 037 000	EUR	7 967 693	7 767 419	0,84
Italy 2.05% 17 - 01.08.27	6 283 000	EUR	6 213 641	6 117 946	0,66
Italy 2.10% 19 - 15.07.26	6 063 000	EUR	6 067 565	5 961 404	0,65
Italy 2.20% 17 - 01.06.27	6 954 000	EUR	6 880 947	6 815 546	0,74
Italy 2.50% 18 - 15.11.25	6 369 000	EUR	6 383 452	6 325 547	0,69
Italy 2.50% 22 - 01.12.32	6 378 000	EUR	5 741 330	5 886 154	0,64
Italy 2.65% 22 - 01.12.27	6 050 000	EUR	5 900 059	6 000 776	0,65
Italy 2.80% 18 - 01.12.28	7 368 000	EUR	7 457 544	7 302 498	0,79

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.80% 22 - 15.06.29	5 305 000	EUR	5 121 380	5 226 644	0,57
Italy 3.00% 19 - 01.08.29	7 615 000	EUR	7 926 465	7 583 278	0,82
Italy 3.40% 22 - 01.04.28	6 415 000	EUR	6 348 142	6 533 036	0,71
Italy 3.40% 23 - 28.03.25	5 454 000	EUR	5 444 601	5 466 762	0,59
Italy 3.50% 22 - 15.01.26	5 827 000	EUR	5 836 567	5 900 886	0,64
Italy 3.60% 23 - 29.09.25	4 062 000	EUR	4 055 006	4 103 351	0,44
Italy 3.70% 23 - 15.06.30	4 826 000	EUR	4 794 117	4 943 996	0,54
Italy 3.80% 23 - 15.04.26	5 320 000	EUR	5 359 627	5 431 880	0,59
Italy 3.80% 23 - 01.08.28	5 893 000	EUR	5 910 040	6 091 653	0,66
Italy 3.85% 22 - 15.12.29	6 348 000	EUR	6 328 389	6 569 228	0,71
Italy 3.85% 23 - 15.09.26	6 429 000	EUR	6 500 339	6 598 276	0,72
Italy 4.00% 23 - 15.11.30	4 959 000	EUR	4 987 553	5 161 526	0,56
Italy 4.10% 23 - 01.02.29	4 393 000	EUR	4 492 305	4 601 272	0,50
Italy 4.20% 23 - 01.03.34	5 430 000	EUR	5 391 148	5 652 196	0,61
Italy 4.35% 23 - 01.11.33	6 873 000	EUR	7 005 573	7 258 094	0,79
Italy 4.40% 22 - 01.05.33	7 168 000	EUR	7 280 556	7 635 911	0,83
Italy 5.20% 04 - 31.07.34	80 000	EUR	107 783	88 301	0,01
Italy 5.25% 98 - 01.11.29	10 430 000	EUR	11 888 766	11 602 853	1,26
Italy 5.75% 02 - 01.02.33	8 974 000	EUR	10 764 330	10 472 793	1,13
Italy 6.00% 00 - 01.05.31	11 075 000	EUR	13 344 462	13 017 555	1,41
Italy 6.50% 97 - 01.11.27	9 402 000	EUR	10 778 779	10 628 930	1,15
Italy 7.25% 97 - 01.11.26	4 097 000	EUR	4 655 441	4 588 271	0,50
Italy 144A 0.60% 21 - 01.08.31	6 934 000	EUR	6 141 808	5 664 105	0,61
Italy 144A 0.95% 21 - 01.03.37	5 692 000	EUR	4 587 599	3 987 246	0,43
Italy 144A 0.95% 21 - 01.12.31	6 855 000	EUR	6 296 901	5 699 268	0,62
Italy 144A 1.45% 20 - 01.03.36	4 857 000	EUR	4 444 630	3 735 689	0,40
Italy 144A 1.50% 21 - 30.04.45	4 297 000	EUR	3 394 396	2 714 857	0,29
Italy 144A 1.65% 15 - 01.03.32	8 766 000	EUR	8 083 588	7 646 056	0,83
Italy 144A 1.65% 20 - 01.12.30	7 402 000	EUR	7 106 609	6 650 228	0,72
Italy 144A 1.70% 20 - 01.09.51	5 554 000	EUR	4 411 755	3 404 920	0,37
Italy 144A 1.80% 20 - 01.03.41	5 518 000	EUR	5 003 932	3 976 944	0,43
Italy 144A 1.85% 20 - 01.07.25	5 849 000	EUR	5 840 132	5 747 818	0,62
Italy 144A 2.15% 21 - 01.03.72	1 982 000	EUR	1 538 891	1 203 879	0,13
Italy 144A 2.15% 22 - 01.09.52	3 011 000	EUR	2 494 412	2 002 736	0,22
Italy 144A 2.25% 16 - 01.09.36	5 470 000	EUR	5 225 317	4 577 829	0,50
Italy 144A 2.45% 17 - 01.09.33	6 570 000	EUR	6 253 039	5 968 678	0,65
Italy 144A 2.45% 20 - 01.09.50	5 213 000	EUR	4 797 970	3 809 504	0,41
Italy 144A 2.70% 16 - 01.03.47	6 236 000	EUR	5 933 423	4 920 515	0,53
Italy 144A 2.80% 16 - 01.03.67	3 220 000	EUR	2 903 813	2 354 528	0,26
Italy 144A 2.95% 18 - 01.09.38	5 019 000	EUR	4 811 368	4 449 126	0,48
Italy 144A 3.10% 19 - 01.03.40	4 801 000	EUR	5 078 667	4 249 890	0,46
Italy 144A 3.25% 15 - 01.09.46	6 218 000	EUR	6 080 814	5 385 099	0,58
Italy 144A 3.25% 22 - 01.03.38	4 328 000	EUR	3 960 457	3 971 962	0,43
Italy 144A 3.35% 19 - 01.03.35	5 253 000	EUR	5 576 678	5 050 659	0,55
Italy 144A 3.45% 17 - 01.03.48	6 185 000	EUR	6 312 523	5 477 931	0,59
Italy 144A 3.50% 14 - 01.03.30	10 075 000	EUR	10 554 256	10 269 235	1,11
Italy 144A 3.85% 19 - 01.09.49	5 244 000	EUR	5 566 119	4 951 385	0,54
Italy 144A 4.00% 05 - 01.02.37	10 799 000	EUR	11 587 699	10 926 795	1,18

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 4.00% 22 - 30.04.35	4 091 000	EUR	3 998 101	4 165 129	0,45
Italy 144A 4.00% 23 - 30.10.31	3 435 000	EUR	3 448 560	3 578 145	0,39
Italy 144A 4.45% 23 - 01.09.43	3 329 000	EUR	3 286 784	3 431 437	0,37
Italy 144A 4.50% 10 - 01.03.26	8 144 000	EUR	8 523 389	8 423 163	0,91
Italy 144A 4.50% 23 - 01.10.53	3 276 000	EUR	3 181 351	3 366 401	0,36
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.28	9 177 000	EUR	10 055 626	9 878 266	1,07
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.44	6 574 000	EUR	8 105 940	7 078 495	0,77
Italy 144A 5.00% 03 - 01.08.34	9 584 000	EUR	11 326 503	10 663 853	1,16
Italy 144A 5.00% 07 - 01.08.39	8 777 000	EUR	10 462 557	9 691 651	1,05
Italy 144A 5.00% 09 - 01.03.25	8 415 000	EUR	8 691 016	8 583 249	0,93
Italy 144A 5.00% 09 - 01.09.40	7 952 000	EUR	9 510 989	8 784 174	0,95
			544 545 619	522 990 260	56,65
Slovaquie					
Slovakia 0.25% 20 - 14.05.25	1 007 000	EUR	971 252	967 324	0,10
Slovakia 0.375% 21 - 21.04.36	1 168 000	EUR	817 705	804 149	0,09
Slovakia 0.75% 19 - 09.04.30	1 007 000	EUR	890 097	882 053	0,09
Slovakia 1.00% 18 - 12.06.28	1 007 000	EUR	934 274	929 062	0,10
Slovakia 1.00% 20 - 09.10.30	1 007 000	EUR	895 223	884 421	0,10
Slovakia 1.00% 20 - 14.05.32	1 007 000	EUR	861 368	851 066	0,09
Slovakia 1.625% 16 - 21.01.31	1 007 000	EUR	929 592	919 542	0,10
Slovakia 1.875% 17 - 09.03.37	1 007 000	EUR	855 950	829 969	0,09
Slovakia 2.00% 17 - 17.10.47	1 099 000	EUR	831 855	810 515	0,09
Slovakia 3.625% 23 - 08.06.33	876 000	EUR	914 491	905 486	0,10
Slovakia 3.75% 23 - 23.02.35	977 000	EUR	1 014 605	1 004 364	0,11
Slovakia 4.00% 22 - 19.10.32	871 000	EUR	935 332	927 558	0,10
Slovakia 4.35% 10 - 14.10.25	1 007 000	EUR	1 032 578	1 027 895	0,11
			11 884 322	11 743 404	1,27
Slovénie					
Slovenia Zero Coupon 21 - 12.02.31	713 000	EUR	569 165	585 203	0,06
Slovenia 1.00% 18 - 06.03.28	812 000	EUR	742 162	759 769	0,08
Slovenia 1.188% 19 - 14.03.29	863 000	EUR	776 958	798 344	0,09
Slovenia 1.25% 17 - 22.03.27	987 000	EUR	925 448	942 087	0,10
Slovenia 1.50% 15 - 25.03.35	871 000	EUR	710 799	735 764	0,08
Slovenia 1.75% 16 - 03.11.40	1 061 000	EUR	816 002	858 593	0,09
Slovenia 2.125% 15 - 28.07.25	596 000	EUR	589 285	588 581	0,07
Slovenia 2.25% 16 - 03.03.32	1 292 000	EUR	1 202 386	1 237 549	0,14
Slovenia 3.125% 15 - 07.08.45	664 000	EUR	622 263	657 754	0,07
			6 954 468	7 163 644	0,78
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	7 010 000	EUR	6 934 899	6 784 068	0,74
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	7 249 000	EUR	7 128 560	6 860 635	0,74
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	9 842 000	EUR	9 156 263	8 896 381	0,96
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	4 000	EUR	3 574	3 616	0,00
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.27	7 414 000	EUR	6 997 529	6 860 638	0,74
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	6 673 000	EUR	6 492 626	6 406 147	0,69
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	8 931 000	EUR	7 999 473	8 096 889	0,88
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	7 951 000	EUR	7 886 650	7 985 905	0,87
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	8 375 000	EUR	10 813 915	10 239 778	1,11

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 6.00% 98 - 31.01.29	9 103 000	EUR	10 934 690	10 588 519	1,15
Spain 144A 0.10% 21 - 30.04.31	8 320 000	EUR	7 441 659	6 874 244	0,75
Spain 144A 0.50% 20 - 30.04.30	8 363 000	EUR	7 688 269	7 334 100	0,79
Spain 144A 0.50% 21 - 31.10.31	7 803 000	EUR	7 133 621	6 561 427	0,71
Spain 144A 0.60% 19 - 31.10.29	8 764 000	EUR	8 270 869	7 827 567	0,85
Spain 144A 0.70% 22 - 30.04.32	8 177 000	EUR	7 198 343	6 898 009	0,75
Spain 144A 0.80% 20 - 30.07.27	7 722 000	EUR	7 586 386	7 274 356	0,79
Spain 144A 0.85% 21 - 30.07.37	4 802 000	EUR	4 090 095	3 548 870	0,38
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	7 491 000	EUR	5 552 162	4 220 261	0,46
Spain 144A 1.00% 21 - 30.07.42	3 804 000	EUR	2 863 327	2 554 196	0,28
Spain 144A 1.20% 20 - 31.10.40	6 677 000	EUR	5 886 207	4 808 575	0,52
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	8 321 000	EUR	8 078 907	7 568 222	0,82
Spain 144A 1.30% 16 - 31.10.26	9 876 000	EUR	9 791 427	9 547 722	1,03
Spain 144A 1.40% 18 - 30.04.28	9 312 000	EUR	9 124 197	8 890 911	0,96
Spain 144A 1.40% 18 - 30.07.28	8 196 000	EUR	8 071 223	7 805 051	0,85
Spain 144A 1.45% 17 - 31.10.27	8 735 000	EUR	8 669 834	8 402 109	0,91
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	7 114 000	EUR	7 078 030	6 726 002	0,73
Spain 144A 1.45% 21 - 31.10.71	2 632 000	EUR	1 693 109	1 335 293	0,14
Spain 144A 1.50% 17 - 30.04.27	8 686 000	EUR	8 604 134	8 406 050	0,91
Spain 144A 1.60% 15 - 30.04.25	7 106 000	EUR	7 116 066	6 982 782	0,76
Spain 144A 1.85% 19 - 30.07.35	7 250 000	EUR	7 132 204	6 391 020	0,69
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	6 313 000	EUR	4 563 074	4 383 684	0,48
Spain 144A 1.95% 15 - 30.07.30	8 414 000	EUR	8 531 582	8 058 424	0,87
Spain 144A 1.95% 16 - 30.04.26	7 456 000	EUR	7 548 367	7 344 085	0,80
Spain 144A 2.15% 15 - 31.10.25	9 020 000	EUR	9 113 667	8 936 836	0,97
Spain 144A 2.35% 17 - 30.07.33	6 886 000	EUR	7 043 500	6 563 804	0,71
Spain 144A 2.55% 22 - 31.10.32	7 733 000	EUR	7 518 504	7 537 471	0,82
Spain 144A 2.70% 18 - 31.10.48	6 423 000	EUR	6 636 104	5 546 646	0,60
Spain 144A 2.90% 16 - 31.10.46	6 532 000	EUR	6 837 706	5 928 443	0,64
Spain 144A 3.15% 23 - 30.04.33	7 989 000	EUR	7 785 219	8 120 688	0,88
Spain 144A 3.45% 16 - 30.07.66	4 990 000	EUR	5 936 675	4 647 673	0,50
Spain 144A 3.45% 22 - 30.07.43	4 129 000	EUR	3 912 572	4 091 032	0,44
Spain 144A 3.50% 23 - 31.05.29	2 228 000	EUR	2 251 544	2 326 325	0,25
Spain 144A 3.55% 23 - 31.10.33	8 592 000	EUR	8 641 046	8 996 486	0,97
Spain 144A 3.90% 23 - 30.07.39	3 670 000	EUR	3 733 164	3 888 456	0,42
Spain 144A 4.20% 05 - 31.01.37	7 669 000	EUR	9 239 102	8 506 148	0,92
Spain 144A 4.65% 10 - 30.07.25	8 448 000	EUR	8 843 249	8 675 674	0,94
Spain 144A 4.70% 09 - 30.07.41	6 996 000	EUR	9 197 665	8 209 176	0,89
Spain 144A 4.90% 07 - 30.07.40	6 802 000	EUR	9 077 565	8 085 401	0,88
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.28	6 800 000	EUR	7 870 027	7 603 760	0,82
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.44	5 529 000	EUR	7 789 982	6 901 961	0,75
Spain 144A 5.90% 11 - 30.07.26	8 171 000	EUR	9 038 101	8 831 952	0,96
			364 526 663	345 863 468	37,47
Total - Obligations			953 117 579	912 777 440	98,88

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	92	EUR	922 151	924 565	0,10
			922 151	924 565	0,10
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			922 151	924 565	0,10
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			954 039 730	913 702 005	98,98
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			954 039 730	913 702 005	98,98
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				922 077 631	99,88

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

Xtrackers II

Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en AUD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.25% 20 - 21.11.25	1 734 000	AUD	1 631 180	1 625 330	3,88
Australia 0.50% 20 - 21.09.26	2 228 000	AUD	2 054 623	2 049 582	4,89
Australia 1.00% 20 - 21.12.30	1 769 000	AUD	1 479 546	1 467 775	3,50
Australia 1.00% 20 - 21.11.31	2 686 000	AUD	2 187 452	2 165 158	5,16
Australia 1.25% 20 - 21.05.32	2 579 000	AUD	2 107 900	2 092 833	4,99
Australia 1.50% 19 - 21.06.31	2 106 000	AUD	1 802 681	1 787 425	4,26
Australia 1.75% 20 - 21.06.51	1 689 000	AUD	1 022 680	998 267	2,38
Australia 1.75% 21 - 21.11.32	2 317 000	AUD	1 953 420	1 940 047	4,63
Australia 2.25% 16 - 21.05.28	1 476 000	AUD	1 393 569	1 393 993	3,32
Australia 2.50% 18 - 21.05.30	2 024 000	AUD	1 889 206	1 879 952	4,48
Australia 2.75% 15 - 21.06.35	1 331 000	AUD	1 177 361	1 176 830	2,81
Australia 2.75% 16 - 21.11.27	1 611 000	AUD	1 559 821	1 560 543	3,72
Australia 2.75% 17 - 21.11.28	1 262 000	AUD	1 213 300	1 211 734	2,89
Australia 2.75% 18 - 21.11.29	1 573 000	AUD	1 498 295	1 492 101	3,56
Australia 2.75% 18 - 21.05.41	1 233 000	AUD	1 024 579	1 006 597	2,40
Australia 3.00% 16 - 21.03.47	1 224 000	AUD	1 008 651	989 212	2,36
Australia 3.00% 22 - 21.11.33	1 939 000	AUD	1 772 284	1 786 633	4,26
Australia 3.25% 12 - 21.04.29	1 805 000	AUD	1 769 531	1 767 438	4,22
Australia 3.25% 13 - 21.04.25	1 820 000	AUD	1 811 561	1 805 604	4,31
Australia 3.25% 15 - 21.06.39	888 000	AUD	801 866	794 920	1,90
Australia 3.50% 23 - 21.12.34	1 534 000	AUD	1 447 403	1 466 765	3,50
Australia 3.75% 14 - 21.04.37	1 119 000	AUD	1 091 695	1 080 629	2,58
Australia 3.75% 22 - 21.05.34	1 620 000	AUD	1 569 374	1 588 216	3,79
Australia 4.25% 14 - 21.04.26	1 719 000	AUD	1 745 307	1 741 175	4,15
Australia 4.50% 13 - 21.04.33	2 118 000	AUD	2 215 774	2 207 295	5,27
Australia 4.75% 11 - 21.04.27	1 902 000	AUD	1 970 872	1 968 570	4,70
Australia 4.75% 23 - 21.06.54	690 000	AUD	637 356	743 427	1,77
			41 837 287	41 788 051	99,68
Total - Obligations			41 837 287	41 788 051	99,68
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			41 837 287	41 788 051	99,68
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			41 837 287	41 788 051	99,68
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				41 942 870	100,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 - 25.10.37	3 600 000	EUR	2 210 045	2 448 252	4,45
France OAT Zero Coupon 09 - 25.10.38	10 500 000	EUR	6 277 305	6 848 625	12,44
France OAT Zero Coupon 10 - 25.04.60	3 300 000	EUR	878 969	1 046 463	1,90
Ville de Paris 3.50% 23 - 10.07.43	500 000	EUR	454 296	517 110	0,94
			9 820 615	10 860 450	19,73
Italie					
Italy Zero Coupon 02 - 01.02.29	6 921 000	EUR	5 552 265	5 901 122	10,72
Italy Zero Coupon 02 - 01.08.29	8 650 000	EUR	6 753 860	7 265 740	13,20
			12 306 125	13 166 862	23,92
Luxembourg					
Luxembourg 3.25% 23 - 02.03.43	907 000	EUR	866 318	960 849	1,74
			866 318	960 849	1,74
Espagne					
Spain Zero Coupon 01 - 30.07.30	6 800 000	EUR	5 396 655	5 696 156	10,35
Spain Zero Coupon 01 - 30.07.31	3 250 000	EUR	2 482 255	2 629 575	4,77
Spain Zero Coupon 14 - 31.10.30	2 210 000	EUR	1 712 632	1 832 930	3,33
			9 591 542	10 158 661	18,45
Supranationales					
European Investment Bank 4.00% 05 - 15.10.37	6 150 000	EUR	6 439 147	6 974 899	12,67
International Bank for Reconstruction & Development 0.125% 20 - 03.01.51	6 625 000	EUR	2 602 394	3 163 504	5,75
International Development Association 0.70% 22 - 17.01.42	780 000	EUR	498 185	530 572	0,96
International Development Association 2.50% 22 - 15.01.38	8 350 000	EUR	7 490 633	7 984 687	14,51
			17 030 359	18 653 662	33,89
Total - Obligations			49 614 959	53 800 484	97,73
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			49 614 959	53 800 484	97,73
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			49 614 959	53 800 484	97,73
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				54 100 042	98,28

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Region de Bruxelles-Capitale 1.50% 23 - 22.06.70	750 000	EUR	346 693	415 725	18,21
			346 693	415 725	18,21
France					
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.24	25 000	EUR	24 721	24 716	1,08
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.28	35 000	EUR	30 639	31 742	1,39
France OAT Zero Coupon 09 - 25.04.50	140 000	EUR	56 896	61 530	2,70
France OAT Zero Coupon 13 - 25.05.45	710 000	EUR	341 940	372 466	16,32
France OAT Zero Coupon 21 - 25.05.67	141 000	EUR	28 026	40 714	1,78
			482 222	531 168	23,27
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 05 - 04.01.37	485 000	EUR	342 533	361 965	15,85
			342 533	361 965	15,85
Italie					
Italy Zero Coupon 00 - 01.05.31	31 000	EUR	23 151	24 279	1,07
Italy 144A 4.00% 05 - 01.02.37	30 000	EUR	28 618	30 424	1,33
			51 769	54 703	2,40
Luxembourg					
Luxembourg 3.25% 23 - 02.03.43	350 000	EUR	334 302	370 779	16,24
			334 302	370 779	16,24
Espagne					
Spain Zero Coupon 01 - 30.07.31	48 000	EUR	35 952	38 837	1,70
			35 952	38 837	1,70
Supranationales					
European Union 0.30% 20 - 04.11.50	57 000	EUR	26 388	29 199	1,28
European Union 0.70% 21 - 06.07.51	50 000	EUR	23 210	28 498	1,25
International Development Association 0.70% 22 - 17.01.42	506 000	EUR	307 298	344 191	15,07
International Development Association 2.50% 22 - 15.01.38	32 000	EUR	28 112	30 600	1,34
			385 008	432 488	18,94
Total - Obligations			1 978 479	2 205 665	96,61
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 978 479	2 205 665	96,61
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 978 479	2 205 665	96,61
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				2 225 930	97,49

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Grèce					
Greece 144A Zero Coupon 21 - 12.02.26	3 689 000	EUR	3 516 170	3 509 715	0,67
Greece 144A 1.875% 19 - 23.07.26	2 049 000	EUR	2 033 510	2 029 268	0,39
Greece 144A 3.375% 18 - 15.02.25	1 750 000	EUR	1 764 088	1 760 745	0,34
			7 313 768	7 299 728	1,40
Italie					
Italy Zero Coupon 21 - 01.04.26	17 048 000	EUR	15 812 124	16 005 430	3,08
Italy Zero Coupon 21 - 01.08.26	14 964 000	EUR	13 694 315	13 933 754	2,68
Italy 0.35% 19 - 01.02.25	15 711 000	EUR	15 390 876	15 229 857	2,93
Italy 0.50% 20 - 01.02.26	16 027 000	EUR	15 019 018	15 267 005	2,93
Italy 1.20% 22 - 15.08.25	12 172 000	EUR	11 831 788	11 829 845	2,27
Italy 1.25% 16 - 01.12.26	16 271 000	EUR	15 617 557	15 583 022	2,99
Italy 1.45% 18 - 15.05.25	13 260 000	EUR	13 067 145	12 978 039	2,49
Italy 1.50% 15 - 01.06.25	16 837 000	EUR	16 563 788	16 474 897	3,17
Italy 1.50% 15 - 01.06.25	290 000	EUR	282 606	283 763	0,05
Italy 1.60% 16 - 01.06.26	18 138 000	EUR	17 274 555	17 637 527	3,39
Italy 2.00% 15 - 01.12.25	16 746 000	EUR	16 323 202	16 475 852	3,17
Italy 2.10% 19 - 15.07.26	14 580 000	EUR	14 093 467	14 335 687	2,76
Italy 2.50% 18 - 15.11.25	15 407 000	EUR	15 246 597	15 301 884	2,94
Italy 3.40% 23 - 28.03.25	12 642 000	EUR	12 621 554	12 671 582	2,44
Italy 3.50% 22 - 15.01.26	13 902 000	EUR	13 915 056	14 078 277	2,71
Italy 3.60% 23 - 29.09.25	10 247 000	EUR	10 228 771	10 351 315	1,99
Italy 3.80% 23 - 15.04.26	12 990 000	EUR	13 076 738	13 263 180	2,55
Italy 3.85% 23 - 15.09.26	15 043 000	EUR	15 159 675	15 439 082	2,97
Italy 7.25% 97 - 01.11.26	10 184 000	EUR	11 261 496	11 405 163	2,19
Italy 144A 1.85% 20 - 01.07.25	14 323 000	EUR	14 161 111	14 075 226	2,70
Italy 144A 4.50% 10 - 01.03.26	18 787 000	EUR	19 235 277	19 430 988	3,73
Italy 144A 5.00% 09 - 01.03.25	20 583 000	EUR	21 192 176	20 994 537	4,04
			311 068 892	313 045 912	60,17
Slovaquie					
Slovakia 0.25% 20 - 14.05.25	2 419 000	EUR	2 333 125	2 323 692	0,45
Slovakia 4.35% 10 - 14.10.25	2 459 000	EUR	2 521 459	2 510 024	0,48
			4 854 584	4 833 716	0,93
Slovénie					
Slovenia 2.125% 15 - 28.07.25	1 572 000	EUR	1 554 268	1 552 432	0,30
			1 554 268	1 552 432	0,30
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	17 498 000	EUR	17 161 407	16 934 039	3,25
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	17 061 000	EUR	15 960 552	16 146 957	3,10
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	16 751 000	EUR	16 231 065	16 081 127	3,09
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	18 834 000	EUR	18 597 776	18 916 681	3,64
Spain 144A 1.30% 16 - 31.10.26	23 064 000	EUR	22 021 821	22 297 353	4,29
Spain 144A 1.60% 15 - 30.04.25	17 342 000	EUR	17 275 066	17 041 290	3,28
Spain 144A 1.95% 16 - 30.04.26	18 815 000	EUR	18 404 090	18 532 587	3,56
Spain 144A 2.15% 15 - 31.10.25	22 120 000	EUR	21 995 215	21 916 054	4,21

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 4.65% 10 - 30.07.25	19 380 000	EUR	20 201 021	19 902 291	3,83
Spain 144A 5.90% 11 - 30.07.26	20 214 000	EUR	21 513 010	21 849 110	4,20
			189 361 023	189 617 489	36,45
Total - Obligations			514 152 535	516 349 277	99,25
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	65	EUR	650 651	653 226	0,13
			650 651	653 226	0,13
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			650 651	653 226	0,13
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			514 803 186	517 002 503	99,38
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			514 803 186	517 002 503	99,38
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				520 845 771	100,12

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.005% 21 - 20.03.26	206 050 000	JPY	206 271 410	205 957 278	0,40
Japan 0.005% 21 - 20.06.26	182 400 000	JPY	182 735 629	182 283 264	0,36
Japan 0.005% 21 - 20.09.26	248 850 000	JPY	249 294 361	248 568 800	0,49
Japan 0.005% 22 - 20.12.26	292 050 000	JPY	291 969 690	291 641 130	0,57
Japan 0.005% 22 - 20.03.27	251 750 000	JPY	251 665 794	251 274 193	0,49
Japan 0.005% 22 - 20.06.27	357 550 000	JPY	357 310 231	356 530 983	0,70
Japan 0.005% 23 - 01.01.25	305 600 000	JPY	305 736 271	305 719 184	0,60
Japan 0.005% 23 - 01.02.25	253 350 000	JPY	253 496 378	253 443 740	0,50
Japan 0.005% 23 - 01.03.25	228 400 000	JPY	228 620 026	228 477 656	0,45
Japan 0.005% 23 - 01.04.25	179 000 000	JPY	179 132 104	179 053 700	0,35
Japan 0.005% 23 - 01.05.25	209 800 000	JPY	210 002 351	209 823 078	0,41
Japan 0.005% 23 - 01.06.25	194 700 000	JPY	194 868 793	194 735 046	0,38
Japan 0.005% 23 - 01.07.25	144 550 000	JPY	144 571 523	144 567 346	0,28
Japan 0.005% 23 - 01.08.25	294 100 000	JPY	294 075 611	294 155 879	0,58
Japan 0.005% 23 - 01.09.25	281 600 000	JPY	281 482 236	281 585 920	0,55
Japan 0.005% 23 - 01.10.25	212 150 000	JPY	211 696 846	212 118 178	0,42
Japan 0.005% 23 - 01.12.25	334 400 000	JPY	334 339 808	334 262 896	0,66
Japan 0.10% 16 - 20.03.26	100 500 000	JPY	100 876 775	100 665 825	0,20
Japan 0.10% 16 - 20.06.26	84 000 000	JPY	84 395 093	84 142 800	0,17
Japan 0.10% 16 - 20.09.26	153 200 000	JPY	153 991 258	153 420 608	0,30
Japan 0.10% 16 - 20.12.26	198 200 000	JPY	199 280 275	198 479 462	0,39
Japan 0.10% 17 - 20.03.27	166 150 000	JPY	166 894 991	166 341 073	0,33
Japan 0.10% 17 - 20.06.27	118 100 000	JPY	118 545 822	118 150 783	0,23
Japan 0.10% 17 - 20.09.27	148 950 000	JPY	149 704 019	148 887 441	0,29
Japan 0.10% 17 - 20.12.27	145 550 000	JPY	146 244 547	145 347 686	0,29
Japan 0.10% 18 - 20.03.28	164 000 000	JPY	164 850 956	163 590 000	0,32
Japan 0.10% 18 - 20.06.28	125 250 000	JPY	125 790 973	124 792 838	0,24
Japan 0.10% 18 - 20.09.28	96 550 000	JPY	96 857 821	96 031 527	0,19
Japan 0.10% 19 - 20.12.28	106 700 000	JPY	106 909 357	106 055 532	0,21
Japan 0.10% 19 - 20.03.29	70 300 000	JPY	70 499 107	69 816 336	0,14
Japan 0.10% 19 - 20.06.29	98 800 000	JPY	98 758 189	98 055 048	0,19
Japan 0.10% 19 - 20.09.29	92 750 000	JPY	93 223 195	91 960 698	0,18
Japan 0.10% 20 - 20.12.29	123 050 000	JPY	123 289 262	121 877 334	0,24
Japan 0.10% 20 - 20.03.30	117 350 000	JPY	116 210 715	116 070 885	0,23
Japan 0.10% 20 - 20.03.25	159 300 000	JPY	159 729 319	159 532 578	0,31
Japan 0.10% 20 - 20.06.30	167 300 000	JPY	167 747 485	165 111 716	0,32
Japan 0.10% 20 - 20.06.25	254 750 000	JPY	255 545 289	255 101 555	0,50
Japan 0.10% 20 - 20.09.30	116 350 000	JPY	115 918 739	114 597 769	0,22
Japan 0.10% 20 - 20.09.25	179 550 000	JPY	180 093 897	179 821 121	0,35
Japan 0.10% 21 - 20.12.30	109 100 000	JPY	107 654 439	107 154 747	0,21
Japan 0.10% 21 - 20.12.25	199 400 000	JPY	200 115 856	199 721 034	0,39
Japan 0.10% 21 - 20.03.31	143 400 000	JPY	143 799 300	140 496 150	0,28
Japan 0.10% 21 - 20.06.31	179 600 000	JPY	179 797 023	175 375 808	0,34
Japan 0.10% 21 - 20.09.31	165 300 000	JPY	163 885 534	160 965 834	0,32
Japan 0.10% 22 - 20.12.31	164 200 000	JPY	161 906 825	159 434 916	0,31
Japan 0.10% 22 - 20.03.27	121 250 000	JPY	121 489 304	121 389 438	0,24
Japan 0.10% 22 - 20.09.27	296 550 000	JPY	296 212 628	296 425 449	0,58
Japan 0.10% 23 - 20.03.28	277 200 000	JPY	277 470 598	276 507 000	0,54

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.10% 23 - 20.06.28	193 200 000	JPY	192 552 772	192 494 820	0,38
Japan 0.10% 23 - 01.11.25	279 400 000	JPY	279 786 196	279 914 096	0,55
Japan 0.20% 16 - 20.06.36	197 200 000	JPY	190 778 391	181 621 200	0,36
Japan 0.20% 22 - 20.06.32	93 800 000	JPY	92 494 943	91 371 518	0,18
Japan 0.20% 22 - 20.09.32	62 000 000	JPY	60 227 742	60 246 020	0,12
Japan 0.20% 23 - 20.12.27	127 500 000	JPY	127 650 960	127 825 125	0,25
Japan 0.20% 23 - 20.03.28	184 100 000	JPY	184 803 163	184 409 288	0,36
Japan 0.20% 23 - 20.06.28	115 850 000	JPY	115 650 256	115 939 205	0,23
Japan 0.30% 15 - 20.12.25	102 450 000	JPY	103 263 521	103 015 524	0,20
Japan 0.30% 16 - 20.06.46	157 600 000	JPY	138 140 169	121 972 944	0,24
Japan 0.30% 19 - 20.06.39	320 750 000	JPY	311 123 421	283 536 585	0,56
Japan 0.30% 19 - 20.09.39	260 250 000	JPY	251 492 858	229 004 385	0,45
Japan 0.30% 20 - 20.12.39	337 200 000	JPY	327 577 966	295 141 044	0,58
Japan 0.30% 23 - 20.12.27	110 650 000	JPY	111 120 918	111 368 119	0,22
Japan 0.30% 23 - 20.06.28	195 200 000	JPY	195 066 802	196 213 088	0,38
Japan 0.30% 23 - 20.09.28	166 350 000	JPY	165 082 626	167 007 083	0,33
Japan 0.40% 15 - 20.03.25	116 650 000	JPY	117 304 747	117 241 416	0,23
Japan 0.40% 15 - 20.06.25	120 250 000	JPY	121 159 583	120 941 438	0,24
Japan 0.40% 15 - 20.09.25	98 900 000	JPY	99 688 268	99 556 696	0,20
Japan 0.40% 16 - 20.03.36	176 250 000	JPY	178 326 006	167 137 875	0,33
Japan 0.40% 16 - 20.03.56	285 350 000	JPY	244 347 613	195 262 152	0,38
Japan 0.40% 19 - 20.03.39	244 950 000	JPY	239 339 256	221 101 668	0,43
Japan 0.40% 19 - 20.06.49	212 500 000	JPY	193 481 053	159 991 250	0,31
Japan 0.40% 19 - 20.09.49	195 900 000	JPY	181 082 595	146 876 025	0,29
Japan 0.40% 20 - 20.12.49	259 950 000	JPY	231 981 842	194 250 237	0,38
Japan 0.40% 20 - 20.03.50	250 700 000	JPY	225 709 551	186 550 884	0,37
Japan 0.40% 20 - 20.03.40	326 450 000	JPY	320 650 388	289 182 468	0,57
Japan 0.40% 20 - 20.06.40	388 050 000	JPY	372 803 962	341 728 472	0,67
Japan 0.40% 20 - 20.09.40	412 400 000	JPY	391 719 658	361 505 716	0,71
Japan 0.40% 21 - 20.06.41	440 300 000	JPY	421 867 180	380 278 304	0,75
Japan 0.40% 23 - 20.06.33	474 850 000	JPY	463 180 593	466 402 419	0,91
Japan 0.40% 23 - 20.09.28	562 600 000	JPY	567 104 433	567 443 986	1,11
Japan 0.50% 16 - 20.09.36	270 800 000	JPY	270 276 250	258 191 552	0,51
Japan 0.50% 16 - 20.09.46	197 450 000	JPY	182 494 907	159 685 713	0,31
Japan 0.50% 18 - 20.03.38	270 800 000	JPY	270 581 683	252 320 608	0,49
Japan 0.50% 18 - 20.06.38	323 200 000	JPY	323 204 082	299 968 384	0,59
Japan 0.50% 19 - 20.12.38	282 650 000	JPY	283 886 314	260 074 745	0,51
Japan 0.50% 19 - 20.03.49	205 350 000	JPY	189 677 731	159 505 613	0,31
Japan 0.50% 19 - 20.03.59	313 850 000	JPY	272 416 581	214 739 309	0,42
Japan 0.50% 20 - 20.03.60	460 150 000	JPY	398 522 489	311 493 941	0,61
Japan 0.50% 21 - 20.12.40	402 100 000	JPY	391 883 617	356 654 658	0,70
Japan 0.50% 21 - 20.03.41	359 550 000	JPY	356 643 459	317 489 841	0,62
Japan 0.50% 21 - 20.09.41	444 200 000	JPY	430 492 285	388 941 520	0,76
Japan 0.50% 22 - 20.12.41	460 650 000	JPY	434 279 712	402 050 714	0,79
Japan 0.50% 23 - 20.12.32	110 250 000	JPY	110 638 278	109 734 030	0,22
Japan 0.50% 23 - 20.03.33	250 400 000	JPY	251 769 950	248 749 864	0,49
Japan 0.60% 16 - 20.12.36	261 300 000	JPY	266 349 516	251 592 705	0,49
Japan 0.60% 16 - 20.12.46	153 350 000	JPY	151 663 829	126 515 284	0,25

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.60% 17 - 20.06.37	211 700 000	JPY	214 511 268	202 243 361	0,40
Japan 0.60% 17 - 20.09.37	277 300 000	JPY	282 318 573	263 984 054	0,52
Japan 0.60% 17 - 20.12.37	235 000 000	JPY	239 211 744	222 944 500	0,44
Japan 0.60% 20 - 20.06.50	289 050 000	JPY	273 597 350	226 638 324	0,44
Japan 0.60% 20 - 20.09.50	304 300 000	JPY	278 619 009	237 685 687	0,47
Japan 0.70% 17 - 20.03.37	240 650 000	JPY	248 493 112	233 774 630	0,46
Japan 0.70% 18 - 20.06.48	264 000 000	JPY	251 808 132	218 589 360	0,43
Japan 0.70% 18 - 20.09.38	241 100 000	JPY	246 687 542	229 428 349	0,45
Japan 0.70% 19 - 20.12.48	204 900 000	JPY	202 374 595	168 327 399	0,33
Japan 0.70% 21 - 20.12.50	334 600 000	JPY	319 277 610	268 088 212	0,53
Japan 0.70% 21 - 20.03.51	312 850 000	JPY	300 516 189	249 760 669	0,49
Japan 0.70% 21 - 20.03.61	459 100 000	JPY	411 498 460	331 314 106	0,65
Japan 0.70% 21 - 20.06.51	311 600 000	JPY	299 048 234	247 852 872	0,49
Japan 0.70% 21 - 20.09.51	324 150 000	JPY	302 724 060	257 128 746	0,50
Japan 0.70% 22 - 20.12.51	338 600 000	JPY	314 367 475	268 100 094	0,53
Japan 0.80% 16 - 20.03.46	177 600 000	JPY	177 647 864	154 781 952	0,30
Japan 0.80% 17 - 20.03.47	156 250 000	JPY	153 179 254	134 471 875	0,26
Japan 0.80% 17 - 20.06.47	159 000 000	JPY	165 740 726	136 514 220	0,27
Japan 0.80% 17 - 20.09.47	175 800 000	JPY	177 046 946	150 453 156	0,30
Japan 0.80% 17 - 20.12.47	185 650 000	JPY	189 425 691	158 368 733	0,31
Japan 0.80% 18 - 20.03.48	186 300 000	JPY	191 311 495	158 541 300	0,31
Japan 0.80% 18 - 20.03.58	265 050 000	JPY	256 495 732	204 101 753	0,40
Japan 0.80% 22 - 20.03.42	422 300 000	JPY	415 517 842	387 472 919	0,76
Japan 0.80% 23 - 20.09.33	586 750 000	JPY	591 127 804	596 578 063	1,17
Japan 0.90% 17 - 20.03.57	263 750 000	JPY	268 471 327	211 472 113	0,41
Japan 0.90% 18 - 20.09.48	143 450 000	JPY	142 266 718	124 102 899	0,24
Japan 0.90% 22 - 20.06.42	417 750 000	JPY	409 543 521	388 728 908	0,76
Japan 1.00% 15 - 20.12.35	254 300 000	JPY	268 729 596	259 396 172	0,51
Japan 1.00% 22 - 20.03.52	316 250 000	JPY	306 406 043	270 893 425	0,53
Japan 1.00% 22 - 20.03.62	431 450 000	JPY	376 234 089	341 975 899	0,67
Japan 1.10% 22 - 20.09.42	368 900 000	JPY	366 545 231	354 439 120	0,70
Japan 1.10% 23 - 20.03.43	331 600 000	JPY	330 183 111	317 029 496	0,62
Japan 1.10% 23 - 20.06.43	397 400 000	JPY	380 914 689	378 801 680	0,74
Japan 1.20% 14 - 20.12.34	242 100 000	JPY	265 498 179	253 984 689	0,50
Japan 1.20% 15 - 20.03.35	258 700 000	JPY	281 742 802	271 042 577	0,53
Japan 1.20% 15 - 20.09.35	234 000 000	JPY	255 597 763	244 319 400	0,48
Japan 1.20% 23 - 20.06.53	321 450 000	JPY	293 698 249	287 745 968	0,56
Japan 1.30% 15 - 20.06.35	205 750 000	JPY	225 913 669	217 539 475	0,43
Japan 1.30% 22 - 20.06.52	321 500 000	JPY	316 627 696	296 410 140	0,58
Japan 1.30% 23 - 20.03.63	303 250 000	JPY	270 845 811	262 581 143	0,52
Japan 1.40% 14 - 20.09.34	266 450 000	JPY	296 717 820	285 192 093	0,56
Japan 1.40% 15 - 20.03.55	131 550 000	JPY	149 392 861	123 068 972	0,24
Japan 1.40% 15 - 20.09.45	84 200 000	JPY	92 268 509	83 107 926	0,16
Japan 1.40% 15 - 20.12.45	102 600 000	JPY	121 618 910	101 065 104	0,20
Japan 1.40% 22 - 20.09.52	305 550 000	JPY	299 355 623	288 488 088	0,57
Japan 1.40% 23 - 20.12.42	347 950 000	JPY	358 213 991	350 622 256	0,69
Japan 1.40% 23 - 20.03.53	317 400 000	JPY	322 316 467	299 006 670	0,59
Japan 1.50% 12 - 20.06.32	99 550 000	JPY	110 379 386	107 631 469	0,21

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.50% 13 - 20.03.33	94 650 000	JPY	105 074 257	102 480 395	0,20
Japan 1.50% 14 - 20.03.34	221 050 000	JPY	247 343 107	239 260 099	0,47
Japan 1.50% 14 - 20.06.34	215 700 000	JPY	243 099 794	233 257 980	0,46
Japan 1.50% 14 - 20.12.44	107 650 000	JPY	123 385 909	108 782 478	0,21
Japan 1.50% 15 - 20.03.45	188 000 000	JPY	209 563 196	189 643 120	0,37
Japan 1.50% 23 - 20.09.43	411 750 000	JPY	412 146 370	419 581 485	0,82
Japan 1.60% 10 - 20.06.30	106 800 000	JPY	117 501 409	115 693 236	0,23
Japan 1.60% 12 - 20.03.32	97 150 000	JPY	107 758 092	105 786 635	0,21
Japan 1.60% 12 - 20.06.32	103 250 000	JPY	115 585 865	112 470 225	0,22
Japan 1.60% 13 - 20.03.33	128 500 000	JPY	144 946 474	140 256 465	0,28
Japan 1.60% 13 - 20.12.33	170 950 000	JPY	191 506 698	186 738 942	0,37
Japan 1.60% 15 - 20.06.45	96 250 000	JPY	111 781 985	98 733 250	0,19
Japan 1.60% 23 - 20.12.52	266 800 000	JPY	277 302 296	263 654 428	0,52
Japan 1.70% 03 - 20.06.33	65 600 000	JPY	72 828 831	72 260 368	0,14
Japan 1.70% 11 - 20.09.31	108 100 000	JPY	121 028 381	118 371 662	0,23
Japan 1.70% 11 - 20.12.31	156 850 000	JPY	175 142 487	171 868 388	0,34
Japan 1.70% 12 - 20.03.32	84 250 000	JPY	95 391 546	92 405 400	0,18
Japan 1.70% 12 - 20.06.32	86 850 000	JPY	98 350 582	95 310 059	0,19
Japan 1.70% 12 - 20.09.32	268 500 000	JPY	301 747 964	295 143 255	0,58
Japan 1.70% 12 - 20.12.32	190 600 000	JPY	215 555 066	209 675 248	0,41
Japan 1.70% 13 - 20.06.33	177 500 000	JPY	202 488 700	195 521 575	0,38
Japan 1.70% 13 - 20.09.33	175 450 000	JPY	199 789 474	193 209 049	0,38
Japan 1.70% 13 - 20.12.43	160 850 000	JPY	190 944 388	169 212 592	0,33
Japan 1.70% 14 - 20.03.44	188 300 000	JPY	223 834 406	197 803 501	0,39
Japan 1.70% 14 - 20.03.54	127 700 000	JPY	154 296 125	128 924 643	0,25
Japan 1.70% 14 - 20.06.44	142 050 000	JPY	172 921 386	149 138 295	0,29
Japan 1.70% 14 - 20.09.44	151 700 000	JPY	178 392 147	159 051 382	0,31
Japan 1.80% 02 - 22.11.32	69 800 000	JPY	79 516 708	77 362 830	0,15
Japan 1.80% 10 - 20.06.30	94 750 000	JPY	104 570 484	103 841 263	0,20
Japan 1.80% 10 - 20.09.30	72 650 000	JPY	80 962 673	79 742 093	0,16
Japan 1.80% 11 - 20.06.31	84 050 000	JPY	93 127 550	92 534 848	0,18
Japan 1.80% 11 - 20.09.31	188 250 000	JPY	212 204 221	207 541 860	0,41
Japan 1.80% 12 - 20.12.31	175 950 000	JPY	198 552 761	194 150 268	0,38
Japan 1.80% 12 - 20.03.32	171 800 000	JPY	194 378 433	189 787 460	0,37
Japan 1.80% 13 - 20.12.32	95 050 000	JPY	108 849 061	105 376 232	0,21
Japan 1.80% 13 - 20.03.43	248 950 000	JPY	301 115 997	267 262 762	0,52
Japan 1.80% 13 - 20.09.43	162 850 000	JPY	195 471 378	174 330 925	0,34
Japan 1.80% 23 - 20.09.53	300 400 000	JPY	306 260 109	310 637 632	0,61
Japan 1.90% 05 - 20.03.25	77 100 000	JPY	79 006 102	78 885 636	0,15
Japan 1.90% 05 - 20.06.25	69 250 000	JPY	71 273 803	71 161 993	0,14
Japan 1.90% 09 - 20.12.28	120 050 000	JPY	131 155 701	129 987 739	0,26
Japan 1.90% 09 - 20.03.29	117 750 000	JPY	129 522 575	127 905 938	0,25
Japan 1.90% 10 - 20.09.30	134 900 000	JPY	151 954 604	148 955 231	0,29
Japan 1.90% 11 - 20.03.31	94 450 000	JPY	106 696 859	104 599 597	0,21
Japan 1.90% 11 - 20.06.31	161 800 000	JPY	182 690 519	179 305 142	0,35
Japan 1.90% 12 - 20.09.42	441 400 000	JPY	536 511 418	482 132 392	0,95
Japan 1.90% 13 - 20.03.53	146 800 000	JPY	180 409 797	155 202 832	0,30
Japan 1.90% 13 - 20.06.43	204 450 000	JPY	251 366 041	222 590 849	0,44

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.00% 04 - 20.12.33	84 100 000	JPY	96 226 853	95 113 736	0,19
Japan 2.00% 05 - 20.09.25	72 600 000	JPY	75 183 611	75 067 674	0,15
Japan 2.00% 06 - 20.12.25	106 850 000	JPY	111 117 933	110 996 849	0,22
Japan 2.00% 07 - 20.03.27	81 700 000	JPY	87 144 922	86 759 681	0,17
Japan 2.00% 10 - 20.06.30	112 550 000	JPY	126 328 845	124 776 307	0,24
Japan 2.00% 10 - 20.09.40	381 250 000	JPY	459 070 505	425 844 813	0,84
Japan 2.00% 11 - 20.12.30	95 800 000	JPY	108 726 391	106 591 870	0,21
Japan 2.00% 11 - 20.03.31	114 250 000	JPY	130 118 464	127 329 340	0,25
Japan 2.00% 11 - 20.09.41	386 900 000	JPY	469 667 551	430 016 136	0,84
Japan 2.00% 12 - 20.03.42	362 550 000	JPY	447 137 887	402 840 182	0,79
Japan 2.00% 12 - 20.03.52	221 600 000	JPY	282 188 818	239 476 472	0,47
Japan 2.10% 03 - 20.09.33	49 800 000	JPY	59 015 159	56 720 706	0,11
Japan 2.10% 05 - 20.03.25	60 400 000	JPY	61 975 506	61 944 428	0,12
Japan 2.10% 05 - 20.09.25	62 400 000	JPY	64 783 211	64 627 056	0,13
Japan 2.10% 05 - 20.12.25	65 000 000	JPY	67 785 939	67 650 050	0,13
Japan 2.10% 06 - 20.03.26	102 500 000	JPY	107 597 455	107 187 325	0,21
Japan 2.10% 06 - 20.12.26	183 050 000	JPY	194 934 675	194 124 525	0,38
Japan 2.10% 07 - 20.03.27	142 550 000	JPY	152 738 883	151 834 282	0,30
Japan 2.10% 07 - 20.06.27	71 800 000	JPY	77 179 348	76 780 766	0,15
Japan 2.10% 07 - 20.09.27	83 100 000	JPY	89 618 914	89 205 357	0,17
Japan 2.10% 07 - 20.12.27	220 100 000	JPY	238 749 840	237 129 137	0,47
Japan 2.10% 08 - 20.06.28	75 000 000	JPY	82 296 545	81 394 500	0,16
Japan 2.10% 08 - 20.09.28	134 600 000	JPY	148 250 471	146 495 948	0,29
Japan 2.10% 08 - 20.12.28	89 050 000	JPY	98 137 161	97 295 140	0,19
Japan 2.10% 09 - 20.03.29	162 950 000	JPY	181 299 587	178 681 193	0,35
Japan 2.10% 09 - 20.06.29	176 900 000	JPY	196 144 158	194 729 751	0,38
Japan 2.10% 09 - 20.09.29	152 750 000	JPY	170 683 927	168 741 398	0,33
Japan 2.10% 09 - 20.12.29	132 200 000	JPY	148 399 079	146 494 786	0,29
Japan 2.10% 10 - 20.03.30	193 850 000	JPY	218 724 055	215 518 553	0,42
Japan 2.10% 10 - 20.12.30	235 150 000	JPY	266 622 395	263 238 668	0,52
Japan 2.20% 06 - 20.03.26	75 950 000	JPY	79 851 239	79 591 043	0,16
Japan 2.20% 06 - 20.06.26	62 050 000	JPY	65 508 555	65 355 404	0,13
Japan 2.20% 06 - 20.09.26	126 050 000	JPY	133 960 848	133 394 934	0,26
Japan 2.20% 07 - 20.09.27	99 100 000	JPY	107 611 983	106 746 556	0,21
Japan 2.20% 08 - 20.03.28	172 200 000	JPY	188 112 978	186 874 884	0,37
Japan 2.20% 08 - 20.09.28	75 600 000	JPY	83 189 144	82 634 580	0,16
Japan 2.20% 09 - 20.03.49	159 650 000	JPY	201 721 274	179 957 480	0,35
Japan 2.20% 09 - 20.06.29	90 400 000	JPY	101 369 453	99 998 672	0,20
Japan 2.20% 09 - 20.09.39	265 100 000	JPY	331 199 315	305 408 455	0,60
Japan 2.20% 10 - 20.12.29	96 250 000	JPY	108 618 555	107 222 500	0,21
Japan 2.20% 10 - 20.03.30	129 750 000	JPY	146 312 632	145 044 930	0,28
Japan 2.20% 10 - 20.03.50	136 750 000	JPY	181 848 577	154 040 670	0,30
Japan 2.20% 11 - 20.03.31	143 550 000	JPY	165 215 670	161 999 046	0,32
Japan 2.20% 11 - 20.03.41	333 400 000	JPY	414 116 065	381 696 324	0,75
Japan 2.20% 11 - 20.03.51	203 100 000	JPY	265 369 501	228 568 740	0,45
Japan 2.30% 02 - 20.05.32	57 250 000	JPY	66 251 597	65 623 958	0,13
Japan 2.30% 05 - 20.03.35	122 150 000	JPY	149 215 699	142 472 096	0,28
Japan 2.30% 05 - 20.06.35	80 750 000	JPY	99 768 083	94 189 223	0,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en JPY)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.30% 06 - 20.12.35	101 900 000	JPY	126 653 662	118 958 060	0,23
Japan 2.30% 06 - 20.03.26	74 400 000	JPY	78 383 416	78 130 416	0,15
Japan 2.30% 06 - 20.06.26	113 550 000	JPY	120 319 461	119 877 006	0,24
Japan 2.30% 07 - 20.12.36	113 650 000	JPY	141 368 396	132 950 043	0,26
Japan 2.30% 07 - 20.06.27	119 500 000	JPY	129 401 257	128 613 070	0,25
Japan 2.30% 08 - 20.06.28	82 800 000	JPY	91 480 204	90 592 308	0,18
Japan 2.30% 09 - 20.03.39	290 800 000	JPY	361 306 682	339 462 472	0,67
Japan 2.30% 10 - 20.03.40	328 400 000	JPY	412 269 871	382 244 464	0,75
Japan 2.40% 04 - 20.03.34	97 350 000	JPY	119 150 504	113 981 274	0,22
Japan 2.40% 05 - 20.12.34	89 300 000	JPY	109 169 858	104 944 467	0,21
Japan 2.40% 07 - 20.03.37	210 750 000	JPY	262 877 386	249 142 328	0,49
Japan 2.40% 07 - 20.03.48	83 850 000	JPY	112 208 855	98 238 660	0,19
Japan 2.40% 08 - 20.03.28	84 000 000	JPY	92 673 329	91 860 720	0,18
Japan 2.40% 08 - 20.06.28	131 950 000	JPY	145 821 957	144 951 034	0,28
Japan 2.40% 08 - 20.09.38	243 200 000	JPY	303 527 163	287 545 088	0,56
Japan 2.50% 04 - 20.06.34	129 150 000	JPY	159 344 545	152 660 466	0,30
Japan 2.50% 04 - 20.09.34	87 850 000	JPY	107 950 860	103 973 111	0,20
Japan 2.50% 05 - 20.09.35	90 950 000	JPY	114 449 219	108 157 740	0,21
Japan 2.50% 06 - 20.03.36	125 150 000	JPY	156 010 274	149 081 183	0,29
Japan 2.50% 06 - 20.06.36	121 650 000	JPY	154 134 203	144 984 903	0,28
Japan 2.50% 06 - 20.09.36	74 950 000	JPY	94 014 880	89 404 857	0,18
Japan 2.50% 07 - 20.09.37	197 700 000	JPY	246 688 764	236 211 960	0,46
Japan 2.50% 08 - 20.03.38	254 050 000	JPY	316 278 949	303 635 479	0,60
			54 006 203 216	50 872 105 719	99,80
Total - Obligations			54 006 203 216	50 872 105 719	99,80
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			54 006 203 216	50 872 105 719	99,80
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			54 006 203 216	50 872 105 719	99,80
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				50 973 304 691	100,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Aurizon Finance Pty Ltd. 3.00% 21 - 09.03.28	100 000	AUD	63 856	61 400	0,01
Australia 0.25% 20 - 21.11.25	519 000	AUD	359 814	332 066	0,05
Australia 0.50% 20 - 21.09.26	500 000	AUD	343 168	313 980	0,05
Australia 1.00% 20 - 21.12.30	411 000	AUD	267 762	232 725	0,03
Australia 1.00% 20 - 21.11.31	493 000	AUD	296 425	271 312	0,04
Australia 1.25% 20 - 21.05.32	494 000	AUD	273 006	273 733	0,04
Australia 1.50% 19 - 21.06.31	564 000	AUD	348 356	326 907	0,05
Australia 1.75% 20 - 21.06.51	202 000	AUD	109 496	81 375	0,01
Australia 1.75% 21 - 21.11.32	419 000	AUD	260 052	239 519	0,03
Australia 2.25% 16 - 21.05.28	439 000	AUD	315 574	283 067	0,04
Australia 2.50% 18 - 21.05.30	417 000	AUD	283 324	264 400	0,04
Australia 2.75% 15 - 21.06.35	150 000	AUD	111 173	90 599	0,01
Australia 2.75% 16 - 21.11.27	539 000	AUD	389 597	356 411	0,05
Australia 2.75% 17 - 21.11.28	366 000	AUD	262 870	239 898	0,03
Australia 2.75% 18 - 21.11.29	415 000	AUD	288 843	268 796	0,04
Australia 2.75% 18 - 21.05.41	170 000	AUD	121 703	94 755	0,01
Australia 3.00% 16 - 21.03.47	250 000	AUD	147 835	137 739	0,02
Australia 3.00% 22 - 21.11.33	320 000	AUD	206 297	201 390	0,03
Australia 3.25% 12 - 21.04.29	472 000	AUD	317 326	315 518	0,05
Australia 3.25% 13 - 21.04.25	420 000	AUD	296 897	284 380	0,04
Australia 3.25% 15 - 21.06.39	110 000	AUD	73 838	67 192	0,01
Australia 3.50% 23 - 21.12.34	220 000	AUD	142 841	143 689	0,02
Australia 3.75% 14 - 21.04.37	133 000	AUD	108 591	87 681	0,01
Australia 3.75% 22 - 21.05.34	200 000	AUD	134 895	133 959	0,02
Australia 4.25% 14 - 21.04.26	500 000	AUD	364 303	345 685	0,05
Australia 4.50% 13 - 21.04.33	277 000	AUD	213 030	197 161	0,03
Australia 4.75% 11 - 21.04.27	487 000	AUD	349 742	344 041	0,05
Australia 4.75% 23 - 21.06.54	60 000	AUD	40 231	44 116	0,01
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3.652% 23 - 20.01.26	100 000	EUR	108 793	111 287	0,02
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3.70% 15 - 16.11.25	50 000	USD	49 197	49 060	0,01
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 5.671% 23 - 03.10.25	50 000	USD	50 078	50 788	0,01
Australian Capital Territory 3.00% 18 - 18.04.28	100 000	AUD	75 612	65 585	0,01
Australian Capital Territory 4.50% 23 - 23.10.34	100 000	AUD	68 970	67 445	0,01
Commonwealth Bank of Australia 0.125% 21 - 15.10.29	100 000	EUR	103 820	94 132	0,01
National Australia Bank Ltd. 0.875% 15 - 19.02.27	100 000	EUR	109 795	103 707	0,02
National Australia Bank Ltd. 1.375% 18 - 30.08.28	100 000	EUR	109 710	102 132	0,01
National Australia Bank Ltd. 2.50% 16 - 12.07.26	60 000	USD	59 247	56 951	0,01
National Australia Bank Ltd. 3.375% 16 - 14.01.26	50 000	USD	48 914	48 726	0,01
National Australia Bank Ltd. 4.944% 23 - 12.01.28	50 000	USD	49 649	50 565	0,01
New South Wales Treasury Corp. 1.25% 19 - 20.03.25	100 000	AUD	62 353	65 992	0,01
New South Wales Treasury Corp. 1.50% 20 - 20.02.32	150 000	AUD	82 607	82 226	0,01
New South Wales Treasury Corp. 1.75% 21 - 20.03.34	100 000	AUD	51 979	52 390	0,01
New South Wales Treasury Corp. 2.00% 19 - 20.03.31	100 000	AUD	69 984	58 649	0,01
New South Wales Treasury Corp. 2.00% 20 - 08.03.33	100 000	AUD	55 525	55 405	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
New South Wales Treasury Corp. 2.25% 20 - 20.11.40	100 000	AUD	62 224	46 546	0,01
New South Wales Treasury Corp. 2.50% 22 - 22.11.32	100 000	AUD	60 120	58 601	0,01
New South Wales Treasury Corp. 3.00% 16 - 20.03.28	200 000	AUD	130 674	131 745	0,02
New South Wales Treasury Corp. 3.00% 16 - 20.02.30	200 000	AUD	150 504	128 107	0,02
New South Wales Treasury Corp. 3.00% 17 - 20.05.27	100 000	AUD	75 729	66 360	0,01
New South Wales Treasury Corp. 4.25% 23 - 20.02.36	100 000	AUD	54 341	64 958	0,01
New South Wales Treasury Corp. 4.75% 22 - 20.02.35	50 000	AUD	33 640	34 296	0,00
Northern Territory Treasury Corp. 2.50% 21 - 21.05.32	100 000	AUD	58 981	58 565	0,01
Northern Territory Treasury Corp. 5.50% 23 - 21.03.36	100 000	AUD	67 116	71 551	0,01
Queensland Treasury Corp. 2.00% 21 - 22.08.33	200 000	AUD	135 278	110 169	0,02
Queensland Treasury Corp. 144A 1.75% 19 - 21.08.31	200 000	AUD	136 797	114 403	0,02
Queensland Treasury Corp. 144A 2.75% 16 - 20.08.27	200 000	AUD	150 121	131 369	0,02
Queensland Treasury Corp. 144A 3.25% 16 - 21.07.28	250 000	AUD	185 187	165 980	0,02
Queensland Treasury Corp. 144A 3.50% 17 - 21.08.30	100 000	AUD	77 410	65 690	0,01
Queensland Treasury Corp. 144A 4.50% 23 - 22.08.35	100 000	AUD	68 477	67 362	0,01
Queensland Treasury Corp. 144A 4.75% 14 - 21.07.25	100 000	AUD	71 935	68 952	0,01
South Australian Government Financing Authority 1.75% 21 - 24.05.34	120 000	AUD	77 768	62 413	0,01
South Australian Government Financing Authority 3.00% 17 - 20.09.27	200 000	AUD	151 383	132 331	0,02
Tasmanian Public Finance Corp. 3.25% 18 - 24.01.28	100 000	AUD	65 969	66 441	0,01
Treasury Corp. of Victoria 0.50% 21 - 20.11.25	200 000	AUD	144 035	127 826	0,02
Treasury Corp. of Victoria 1.50% 20 - 20.11.30	150 000	AUD	92 969	85 284	0,01
Treasury Corp. of Victoria 2.25% 20 - 20.11.41	100 000	AUD	61 560	45 578	0,01
Treasury Corp. of Victoria 2.25% 21 - 15.09.33	100 000	AUD	53 669	55 423	0,01
Treasury Corp. of Victoria 2.40% 20 - 18.08.50	60 000	AUD	24 019	24 585	0,00
Treasury Corp. of Victoria 2.50% 19 - 22.10.29	200 000	AUD	146 485	124 768	0,02
Treasury Corp. of Victoria 3.00% 15 - 20.10.28	200 000	AUD	150 853	130 333	0,02
Treasury Corp. of Victoria 4.25% 13 - 20.12.32	200 000	AUD	162 932	133 388	0,02
Treasury Corp. of Victoria 4.75% 22 - 15.09.36	100 000	AUD	71 106	67 071	0,01
Treasury Corp. of Victoria 5.50% 11 - 17.11.26	100 000	AUD	70 385	71 061	0,01
Vicinity Centres Trust 3.375% 16 - 07.04.26	100 000	GBP	133 785	123 193	0,02
Western Australian Treasury Corp. 1.75% 20 - 22.10.31	100 000	AUD	57 408	57 006	0,01
Western Australian Treasury Corp. 2.75% 19 - 24.07.29	100 000	AUD	73 989	64 032	0,01
Western Australian Treasury Corp. 3.00% 17 - 21.10.26	100 000	AUD	75 744	66 666	0,01
Western Australian Treasury Corp. 4.25% 23 - 20.07.33	100 000	AUD	65 589	67 670	0,01
Westpac Banking Corp. 0.01% 21 - 22.09.28	100 000	EUR	104 539	95 963	0,01
Westpac Banking Corp. 1.15% 21 - 03.06.26	95 000	USD	90 963	87 545	0,01
Westpac Banking Corp. 1.953% 21 - 20.11.28	40 000	USD	37 556	35 474	0,01
Westpac Banking Corp. 2.15% 21 - 03.06.31	40 000	USD	36 801	33 818	0,00
Westpac Banking Corp. FRN 20 - 15.11.35	40 000	USD	35 425	32 557	0,00
Westpac Banking Corp. 3.133% 21 - 18.11.41	70 000	USD	60 024	48 878	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Westpac Banking Corp. 3.35% 17 - 08.03.27	20 000	USD	20 106	19 279	0,00
Westpac Banking Corp. FRN 19 - 24.07.34	25 000	USD	24 648	22 900	0,00
Westpac Banking Corp. 5.457% 22 - 18.11.27	160 000	USD	163 047	165 408	0,02
			11 418 369	10 580 079	1,55
Autriche					
Austria 6.25% 97 - 15.07.27	100 000	EUR	133 493	125 127	0,02
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.02.30	154 000	EUR	157 991	147 295	0,02
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.10.40	58 000	EUR	52 799	40 160	0,01
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.02.31	134 000	EUR	124 610	124 528	0,02
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.04.25	120 000	EUR	115 520	127 997	0,02
Austria 144A Zero Coupon 22 - 20.10.28	70 000	EUR	70 097	69 296	0,01
Austria 144A 0.25% 21 - 20.10.36	50 000	EUR	38 414	40 555	0,01
Austria 144A 0.50% 17 - 20.04.27	185 000	EUR	190 555	192 926	0,03
Austria 144A 0.50% 19 - 20.02.29	198 000	EUR	204 823	199 762	0,03
Austria 144A 0.70% 21 - 20.04.71	60 000	EUR	50 344	31 695	0,00
Austria 144A 0.75% 16 - 20.10.26	164 000	EUR	182 511	173 461	0,02
Austria 144A 0.75% 18 - 20.02.28	115 000	EUR	127 883	119 392	0,02
Austria 144A 0.75% 20 - 20.03.51	112 000	EUR	81 804	75 419	0,01
Austria 144A 0.85% 20 - 30.06.20	70 000	EUR	39 104	36 680	0,00
Austria 144A 0.90% 22 - 20.02.32	150 000	EUR	157 237	145 830	0,02
Austria 144A 1.20% 15 - 20.10.25	150 000	EUR	160 592	162 135	0,02
Austria 144A 1.50% 16 - 20.02.47	139 000	EUR	135 167	118 111	0,02
Austria 144A 1.50% 16 - 02.11.86	29 000	EUR	32 663	20 295	0,00
Austria 144A 1.85% 22 - 23.05.49	50 000	EUR	50 814	45 202	0,01
Austria 144A 2.00% 22 - 15.07.26	100 000	EUR	103 708	109 561	0,02
Austria 144A 2.10% 17 - 20.09.17	60 000	EUR	57 099	52 197	0,01
Austria 144A 2.40% 13 - 23.05.34	140 000	EUR	176 085	151 581	0,02
Austria 144A 2.90% 23 - 20.02.33	176 000	EUR	191 770	199 431	0,03
Austria 144A 3.15% 12 - 20.06.44	90 000	EUR	129 721	103 890	0,01
Austria 144A 3.15% 23 - 20.10.53	50 000	EUR	55 208	57 831	0,01
Austria 144A 3.45% 23 - 20.10.30	100 000	EUR	112 916	117 338	0,02
Austria 144A 3.80% 12 - 26.01.62	50 000	EUR	96 917	66 332	0,01
Austria 144A 4.15% 07 - 15.03.37	165 000	EUR	251 719	209 267	0,03
Austria 144A 4.85% 09 - 15.03.26	100 000	EUR	121 801	116 142	0,02
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG 3.375% 10 - 22.09.25	100 000	EUR	115 337	111 447	0,02
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0.25% 22 - 12.01.32	100 000	EUR	89 509	89 508	0,01
Erste Group Bank AG FRN 20 - 16.11.28	100 000	EUR	103 198	97 526	0,01
Oesterreichische Kontrollbank AG 0.50% 21 - 02.02.26	200 000	USD	190 355	184 848	0,03
Oesterreichische Kontrollbank AG 2.875% 05 - 25.02.30	50 000	CHF	60 981	65 442	0,01
Oesterreichische Kontrollbank AG 4.625% 22 - 03.11.25	100 000	USD	99 005	100 234	0,01
Raiffeisen Bank International AG 5.75% 22 - 27.01.28	100 000	EUR	100 141	118 194	0,02
			4 161 891	3 946 635	0,58

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Belfius Bank SA 0.75% 15 - 10.02.25	100 000	EUR	110 259	107 226	0,02
Belfius Bank SA 3.125% 16 - 11.05.26	100 000	EUR	112 870	109 082	0,02
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	106 000	EUR	166 290	129 542	0,02
Belgium 4.00% 12 - 28.03.32	120 000	EUR	164 899	147 381	0,02
Belgium 5.50% 98 - 28.03.28	215 000	EUR	287 856	268 624	0,04
Belgium 144A Zero Coupon 20 - 22.10.27	200 000	EUR	198 927	203 271	0,03
Belgium 144A Zero Coupon 21 - 22.10.31	100 000	EUR	90 242	91 371	0,01
Belgium 144A 0.10% 20 - 22.06.30	139 000	EUR	146 843	133 157	0,02
Belgium 144A 0.35% 22 - 22.06.32	170 000	EUR	147 123	156 985	0,02
Belgium 144A 0.40% 20 - 22.06.40	70 000	EUR	45 549	51 578	0,01
Belgium 144A 0.65% 21 - 22.06.71	60 000	EUR	44 329	29 879	0,00
Belgium 144A 0.80% 15 - 22.06.25	246 000	EUR	268 200	264 491	0,04
Belgium 144A 0.80% 17 - 22.06.27	150 000	EUR	167 277	157 835	0,02
Belgium 144A 0.80% 18 - 22.06.28	268 000	EUR	287 815	278 458	0,04
Belgium 144A 0.90% 19 - 22.06.29	223 000	EUR	225 558	229 064	0,03
Belgium 144A 1.00% 15 - 22.06.31	250 000	EUR	278 581	249 483	0,04
Belgium 144A 1.00% 16 - 22.06.26	200 000	EUR	209 964	213 900	0,03
Belgium 144A 1.25% 18 - 22.04.33	120 000	EUR	135 940	118 662	0,02
Belgium 144A 1.40% 22 - 22.06.53	120 000	EUR	95 570	88 929	0,01
Belgium 144A 1.45% 17 - 22.06.37	80 000	EUR	80 405	74 636	0,01
Belgium 144A 1.60% 16 - 22.06.47	140 000	EUR	157 526	116 446	0,02
Belgium 144A 1.70% 19 - 22.06.50	170 000	EUR	174 328	140 043	0,02
Belgium 144A 1.90% 15 - 22.06.38	140 000	EUR	167 735	136 506	0,02
Belgium 144A 2.15% 16 - 22.06.66	110 000	EUR	114 131	96 464	0,01
Belgium 144A 2.25% 17 - 22.06.57	67 000	EUR	86 781	60 801	0,01
Belgium 144A 2.75% 22 - 22.04.39	50 000	EUR	51 688	53 953	0,01
Belgium 144A 3.00% 14 - 22.06.34	100 000	EUR	119 638	113 718	0,02
Belgium 144A 3.00% 23 - 22.06.33	215 000	EUR	234 691	245 250	0,04
Belgium 144A 3.30% 23 - 22.06.54	100 000	EUR	107 016	112 758	0,02
Belgium 144A 3.45% 23 - 22.06.43	100 000	EUR	107 244	116 580	0,02
Belgium 144A 4.25% 10 - 28.03.41	190 000	EUR	301 194	245 411	0,04
Belgium 144A 4.50% 11 - 28.03.26	150 000	EUR	181 342	173 215	0,02
Belgium 144A 5.00% 04 - 28.03.35	200 000	EUR	272 335	268 949	0,04
BNP Paribas Fortis SA 0.875% 18 - 22.03.28	100 000	EUR	103 989	102 133	0,01
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 19 - 14.01.26	100 000	EUR	110 817	106 204	0,01
Elia Transmission Belgium SA 3.625% 23 - 18.01.33	100 000	EUR	108 368	114 008	0,02
ING Belgium SA 0.625% 18 - 30.05.25	100 000	EUR	109 980	106 588	0,01
KBC Group NV FRN 22 - 23.11.27	100 000	EUR	104 100	113 060	0,02
			5 877 400	5 525 641	0,81
Bermudes					
Arch Capital Group Ltd. 3.635% 20 - 30.06.50	45 000	USD	40 621	34 506	0,00
			40 621	34 506	0,00
Bulgarie					
Bulgaria 1.375% 20 - 23.09.50	50 000	EUR	44 272	33 541	0,00
Bulgaria 4.625% 22 - 23.09.34	100 000	EUR	106 254	117 576	0,02
			150 526	151 117	0,02
Canada					
407 International Inc. 2.84% 20 - 07.03.50	75 000	CAD	41 137	42 992	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
407 International Inc. 3.83% 15 - 11.05.46	20 000	CAD	15 587	13 809	0,00
Alectra Inc. 2.488% 17 - 17.05.27	20 000	CAD	15 117	14 411	0,00
Bank of Montreal 0.125% 22 - 26.01.27	150 000	EUR	161 034	152 042	0,02
Bank of Montreal FRN 21 - 22.01.27	40 000	USD	37 888	36 909	0,01
Bank of Montreal 1.25% 21 - 15.09.26	20 000	USD	19 005	18 229	0,00
Bank of Montreal 1.551% 21 - 28.05.26	20 000	CAD	15 314	14 229	0,00
Bank of Montreal 1.758% 21 - 10.03.26	10 000	CAD	7 725	7 188	0,00
Bank of Montreal 1.85% 20 - 01.05.25	25 000	USD	24 622	23 987	0,00
Bank of Montreal 2.70% 16 - 09.12.26	10 000	CAD	7 903	7 282	0,00
Bank of Montreal FRN 22 - 10.01.37	100 000	USD	92 119	81 111	0,01
Bank of Montreal 3.19% 18 - 01.03.28	25 000	CAD	19 936	18 306	0,00
Bank of Montreal 3.70% 22 - 07.06.25	25 000	USD	24 598	24 522	0,00
Bank of Montreal FRN 17 - 15.12.32	50 000	USD	44 486	46 023	0,01
Bank of Montreal 4.309% 22 - 01.06.27	120 000	CAD	86 455	90 582	0,01
Bank of Montreal 4.609% 10 - 10.09.25	50 000	CAD	37 654	37 966	0,01
Bank of Montreal 4.70% 22 - 14.09.27	50 000	USD	49 670	50 166	0,01
Bank of Montreal FRN 22 - 27.10.32	50 000	CAD	38 085	39 970	0,01
Bank of Nova Scotia 0.01% 21 - 14.09.29	100 000	EUR	92 533	93 730	0,01
Bank of Nova Scotia 1.30% 20 - 11.06.25	60 000	USD	58 538	56 857	0,01
Bank of Nova Scotia 1.40% 20 - 01.11.27	50 000	CAD	36 907	34 192	0,01
Bank of Nova Scotia 1.95% 22 - 02.02.27	100 000	USD	96 112	92 202	0,01
Bank of Nova Scotia 2.15% 21 - 01.08.31	10 000	USD	9 113	8 312	0,00
Bank of Nova Scotia 2.16% 20 - 03.02.25	100 000	CAD	72 940	73 442	0,01
Bank of Nova Scotia 2.45% 22 - 02.02.32	100 000	USD	87 061	83 894	0,01
Bank of Nova Scotia 2.62% 16 - 02.12.26	50 000	CAD	39 424	36 333	0,01
Bank of Nova Scotia 2.70% 19 - 03.08.26	100 000	USD	95 427	94 786	0,01
Bank of Nova Scotia 3.25% 23 - 18.01.28	150 000	EUR	161 496	167 862	0,03
Bank of Nova Scotia FRN 22 - 03.05.32	25 000	CAD	19 939	18 336	0,00
Bell Canada 1.65% 20 - 16.08.27	10 000	CAD	7 462	6 990	0,00
Bell Canada 2.15% 21 - 15.02.32	50 000	USD	45 332	41 553	0,01
Bell Canada 2.20% 21 - 29.05.28	10 000	CAD	7 513	6 976	0,00
Bell Canada 2.50% 20 - 14.05.30	10 000	CAD	7 357	6 783	0,00
Bell Canada 2.75% 19 - 29.01.25	10 000	CAD	7 944	7 397	0,00
Bell Canada 2.90% 16 - 12.08.26	10 000	CAD	7 869	7 324	0,00
Bell Canada 2.90% 19 - 10.09.29	10 000	CAD	7 607	7 045	0,00
Bell Canada 3.00% 21 - 17.03.31	10 000	CAD	7 474	6 886	0,00
Bell Canada 3.35% 18 - 12.03.25	20 000	CAD	15 996	14 894	0,00
Bell Canada 3.50% 20 - 30.09.50	20 000	CAD	13 121	11 811	0,00
Bell Canada 3.60% 17 - 29.09.27	10 000	CAD	7 982	7 406	0,00
Bell Canada 3.65% 21 - 17.03.51	25 000	USD	23 339	19 239	0,00
Bell Canada 3.80% 18 - 21.08.28	10 000	CAD	8 015	7 440	0,00
Bell Canada 4.05% 21 - 17.03.51	10 000	CAD	7 183	6 510	0,00
Bell Canada 4.35% 15 - 18.12.45	10 000	CAD	7 612	6 894	0,00
Bell Canada 4.45% 17 - 27.02.47	10 000	CAD	7 696	6 987	0,00
Bell Canada 4.464% 18 - 01.04.48	50 000	USD	53 027	44 950	0,01
Bell Canada 4.75% 14 - 29.09.44	10 000	CAD	8 011	7 305	0,00
Bell Telephone Co. of Canada or Bell Canada 3.55% 16 - 02.03.26	10 000	CAD	8 010	7 382	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.25% 20 - 01.03.26	430 000	CAD	328 216	303 439	0,04
Canada 0.50% 20 - 01.09.25	610 000	CAD	443 201	437 418	0,06
Canada 0.50% 20 - 01.12.30	520 000	CAD	365 880	331 592	0,05
Canada 1.00% 16 - 01.06.27	300 000	CAD	225 012	211 165	0,03
Canada 1.00% 21 - 01.09.26	290 000	CAD	223 636	206 248	0,03
Canada 1.25% 19 - 01.03.25	220 000	CAD	173 491	161 138	0,02
Canada 1.25% 21 - 01.03.27	240 000	CAD	176 215	170 483	0,03
Canada 1.50% 15 - 01.06.26	275 000	CAD	207 071	198 740	0,03
Canada 1.50% 19 - 01.06.30	680 000	CAD	497 799	461 153	0,07
Canada 1.50% 21 - 01.06.31	543 000	CAD	396 589	368 380	0,05
Canada 1.50% 21 - 01.12.31	413 000	CAD	300 819	278 282	0,04
Canada 1.50% 22 - 01.04.25	150 000	CAD	111 614	109 942	0,02
Canada 1.625% 20 - 22.01.25	200 000	USD	198 469	193 800	0,03
Canada 1.75% 21 - 01.12.53	500 000	CAD	291 391	286 008	0,04
Canada 2.00% 17 - 01.06.28	200 000	CAD	150 177	144 734	0,02
Canada 2.00% 17 - 01.12.51	716 000	CAD	504 714	438 663	0,06
Canada 2.00% 22 - 01.06.32	290 000	CAD	210 777	202 184	0,03
Canada 2.25% 14 - 01.06.25	180 000	CAD	129 808	133 115	0,02
Canada 2.25% 18 - 01.06.29	160 000	CAD	127 342	116 521	0,02
Canada 2.25% 22 - 01.12.29	80 000	CAD	57 099	58 119	0,01
Canada 2.50% 14 - 01.12.48	223 000	CAD	173 803	161 033	0,02
Canada 2.50% 22 - 01.12.32	307 000	CAD	218 036	222 185	0,03
Canada 2.75% 14 - 01.12.64	130 000	CAD	94 367	93 929	0,01
Canada 2.75% 22 - 01.09.27	210 000	CAD	154 739	156 235	0,02
Canada 2.75% 23 - 01.12.55	185 000	CAD	124 811	132 740	0,02
Canada 2.75% 23 - 01.06.33	260 000	CAD	175 378	191 837	0,03
Canada 2.875% 22 - 28.04.25	200 000	USD	196 747	195 582	0,03
Canada 3.00% 22 - 01.10.25	100 000	CAD	72 555	74 668	0,01
Canada 3.00% 23 - 01.04.26	150 000	CAD	108 571	112 128	0,02
Canada 3.25% 23 - 01.09.28	250 000	CAD	185 333	190 315	0,03
Canada 3.25% 23 - 01.12.33	80 000	CAD	61 403	61 525	0,01
Canada 3.50% 11 - 01.12.45	200 000	CAD	185 472	162 327	0,02
Canada 3.50% 22 - 01.03.28	280 000	CAD	208 020	214 638	0,03
Canada 3.50% 23 - 01.08.25	140 000	CAD	103 672	105 261	0,02
Canada 3.75% 22 - 01.02.25	300 000	CAD	219 434	225 867	0,03
Canada 3.75% 23 - 01.05.25	100 000	CAD	73 112	75 381	0,01
Canada 4.00% 08 - 01.06.41	202 000	CAD	183 590	171 951	0,03
Canada 4.00% 23 - 01.03.29	150 000	CAD	115 933	118 443	0,02
Canada 5.00% 04 - 01.06.37	160 000	CAD	163 118	146 352	0,02
Canada 5.75% 98 - 01.06.29	240 000	CAD	213 215	205 995	0,03
Canada 5.75% 01 - 01.06.33	170 000	CAD	172 435	156 298	0,02
Canada 8.00% 96 - 01.06.27	200 000	CAD	171 341	174 658	0,03
Canada 9.00% 94 - 01.06.25	180 000	CAD	152 662	145 575	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 0.95% 20 - 15.06.25	200 000	CAD	156 245	144 810	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 1.25% 21 - 15.06.26	120 000	CAD	92 889	85 681	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Housing Trust No 1 144A 1.40% 21 - 15.03.31	100 000	CAD	72 540	66 142	0,01
Canada Housing Trust No 1 144A 1.55% 21 - 15.12.26	150 000	CAD	116 269	107 191	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 1.60% 21 - 15.12.31	50 000	CAD	36 426	33 108	0,01
Canada Housing Trust No 1 144A 1.75% 20 - 15.06.30	100 000	CAD	74 997	68 690	0,01
Canada Housing Trust No 1 144A 1.80% 19 - 15.12.24	200 000	CAD	158 819	147 784	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 1.90% 16 - 15.09.26	100 000	CAD	78 498	72 365	0,01
Canada Housing Trust No 1 144A 1.90% 21 - 15.03.31	100 000	CAD	68 412	68 555	0,01
Canada Housing Trust No 1 144A 1.95% 15 - 15.12.25	200 000	CAD	158 091	146 002	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 2.10% 19 - 15.09.29	100 000	CAD	77 162	70 833	0,01
Canada Housing Trust No 1 144A 2.25% 15 - 15.12.25	150 000	CAD	106 556	110 136	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 2.35% 17 - 15.06.27	200 000	CAD	158 418	145 853	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 2.45% 22 - 15.12.31	200 000	CAD	145 517	141 332	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 2.65% 18 - 15.12.28	80 000	CAD	63 734	58 641	0,01
Canada Housing Trust No 1 144A 3.55% 22 - 15.09.32	130 000	CAD	96 848	99 269	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 3.60% 22 - 15.12.27	50 000	CAD	37 095	38 108	0,01
Canada Housing Trust No 1 144A 4.15% 23 - 15.06.33	200 000	CAD	149 396	159 671	0,02
Canada Housing Trust No 1 144A 4.25% 23 - 15.03.34	200 000	CAD	150 465	161 182	0,02
Canada Post Corp. 4.08% 10 - 16.07.25	6 000	CAD	4 912	4 536	0,00
Canada Post Corp. 4.36% 10 - 16.07.40	7 000	CAD	6 340	5 578	0,00
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.01% 21 - 30.04.29	100 000	EUR	92 193	94 997	0,01
Canadian Imperial Bank of Commerce 1.70% 21 - 15.07.26	25 000	CAD	19 143	17 799	0,00
Canadian Imperial Bank of Commerce 2.00% 20 - 17.04.25	75 000	CAD	58 924	54 824	0,01
Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 20 - 21.07.30	107 000	CAD	76 031	77 479	0,01
Canadian Imperial Bank of Commerce 2.25% 20 - 28.01.25	140 000	USD	138 852	135 617	0,02
Canadian Imperial Bank of Commerce 3.60% 22 - 07.04.32	50 000	USD	45 372	45 675	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Canadian Imperial Bank of Commerce 5.05% 22 - 07.10.27	100 000	CAD	76 401	77 211	0,01
Canadian National Railway Co. 2.45% 20 - 01.05.50	50 000	USD	40 694	32 896	0,01
Canadian National Railway Co. 3.20% 16 - 02.08.46	25 000	USD	23 102	19 409	0,00
Canadian National Railway Co. 3.60% 17 - 01.08.47	10 000	CAD	7 460	6 593	0,00
Canadian Pacific Railway Co. 1.75% 21 - 02.12.26	25 000	USD	24 094	23 079	0,00
Canadian Pacific Railway Co. 2.45% 21 - 02.12.31	25 000	USD	23 416	23 211	0,00
Canadian Pacific Railway Co. 2.54% 21 - 28.02.28	20 000	CAD	15 338	14 242	0,00
Canadian Pacific Railway Co. 3.00% 21 - 02.12.41	25 000	USD	22 396	22 376	0,00
Canadian Pacific Railway Co. 3.50% 23 - 01.05.50	25 000	USD	23 043	19 264	0,00
Canadian Pacific Railway Co. 4.80% 15 - 01.08.45	25 000	USD	27 453	23 598	0,00
Canadian Pacific Railway Co. 6.125% 15 - 15.09.15	25 000	USD	31 203	27 909	0,00
Canadian Western Bank 1.926% 21 - 16.04.26	10 000	CAD	7 702	7 140	0,00
Canadian Western Bank 2.606% 20 - 30.01.25	10 000	CAD	7 921	7 365	0,00
CGI Inc. 2.10% 21 - 18.09.28	10 000	CAD	7 437	6 890	0,00
Choice Properties Real Estate Investment Trust 2.848% 20 - 21.05.27	30 000	CAD	20 989	21 510	0,00
Cogeco Communications Inc. 2.991% 21 - 22.09.31	10 000	CAD	7 316	6 635	0,00
Enbridge Inc. 2.44% 20 - 02.06.25	10 000	CAD	7 879	7 339	0,00
Enbridge Inc. 2.50% 21 - 01.08.33	25 000	USD	22 612	20 485	0,00
Enbridge Inc. 2.99% 19 - 03.10.29	10 000	CAD	7 551	7 007	0,00
Enbridge Inc. 3.10% 21 - 21.09.33	20 000	CAD	14 322	13 148	0,00
Enbridge Inc. 3.125% 19 - 15.11.29	245 000	USD	225 568	224 359	0,03
Enbridge Inc. 3.20% 17 - 08.06.27	20 000	CAD	15 689	14 588	0,00
Enbridge Inc. 3.70% 17 - 15.07.27	25 000	USD	25 200	24 158	0,00
Enbridge Inc. 4.24% 12 - 27.08.42	10 000	CAD	7 240	6 656	0,00
Enbridge Inc. 4.25% 16 - 01.12.26	25 000	USD	25 534	24 700	0,00
Enbridge Inc. 4.57% 14 - 11.03.44	60 000	CAD	42 139	41 516	0,01
Enbridge Inc. 5.50% 16 - 01.12.46	90 000	USD	86 112	89 058	0,01
Enbridge Pipelines Inc. 3.45% 15 - 29.09.25	10 000	CAD	8 004	7 392	0,00
Enbridge Pipelines Inc. 3.52% 19 - 22.02.29	10 000	CAD	7 880	7 284	0,00
Enbridge Pipelines Inc. 4.33% 19 - 22.02.49	10 000	CAD	7 341	6 705	0,00
Export Development Canada 3.375% 22 - 26.08.25	200 000	USD	195 183	196 520	0,03
Export Development Canada 3.875% 23 - 14.02.28	210 000	USD	211 145	208 849	0,03
Export Development Canada 4.40% 23 - 22.01.27	200 000	AUD	132 719	137 443	0,02
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 1.093% 21 - 21.01.26	10 000	CAD	7 625	7 084	0,00
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 1.587% 21 - 10.09.26	30 000	CAD	20 148	21 218	0,00
Federation des Caisses Desjardins du Quebec FRN 21 - 28.05.31	15 000	CAD	11 293	10 611	0,00
Federation des Caisses Desjardins du Quebec FRN 20 - 26.05.30	10 000	CAD	7 837	7 331	0,00
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 5.20% 22 - 01.10.25	50 000	CAD	36 966	38 188	0,01
Financement-Quebec 5.25% 06 - 01.06.34	50 000	CAD	40 270	42 389	0,01
Gibson Energy Inc. 3.60% 19 - 17.09.29	10 000	CAD	7 730	7 164	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Greater Toronto Airports Authority 2.73% 19 - 03.04.29	50 000	CAD	36 885	35 908	0,01
Greater Toronto Airports Authority 5.30% 11 - 25.02.41	10 000	CAD	9 322	8 438	0,00
Greater Toronto Airports Authority 7.05% 00 - 12.06.30	10 000	CAD	9 478	8 735	0,00
Great-West Lifeco Inc. 2.379% 20 - 14.05.30	20 000	CAD	14 789	13 671	0,00
Great-West Lifeco Inc. 2.981% 20 - 08.07.50	50 000	CAD	26 361	29 463	0,00
Honda Canada Finance Inc. 1.337% 20 - 17.03.26	10 000	CAD	7 630	7 091	0,00
Honda Canada Finance Inc. 1.646% 21 - 25.02.28	10 000	CAD	7 371	6 832	0,00
Honda Canada Finance Inc. 3.444% 18 - 23.05.25	10 000	CAD	8 003	7 454	0,00
Honda Canada Finance Inc. 4.873% 23 - 23.09.27	80 000	CAD	59 778	61 712	0,01
HSBC Bank Canada 1.782% 21 - 20.05.26	20 000	CAD	15 387	14 327	0,00
Hydro One Inc. 2.71% 20 - 28.02.50	10 000	CAD	6 426	5 590	0,00
Hydro One Inc. 2.77% 16 - 24.02.26	10 000	CAD	7 944	7 376	0,00
Hydro One Inc. 3.02% 19 - 05.04.29	10 000	CAD	7 879	7 270	0,00
Hydro One Inc. 3.63% 18 - 25.06.49	10 000	CAD	7 604	6 649	0,00
Hydro One Inc. 5.36% 05 - 20.05.36	10 000	CAD	9 131	8 245	0,00
Hydro One Inc. 5.49% 09 - 16.07.40	10 000	CAD	9 455	8 463	0,00
Hydro One Inc. 6.93% 01 - 01.06.32	10 000	CAD	9 710	8 913	0,00
Hydro-Quebec 2.10% 20 - 15.02.60	95 000	CAD	56 073	47 718	0,01
Hydro-Quebec 4.00% 14 - 15.02.55	95 000	CAD	84 774	73 193	0,01
Hydro-Quebec 4.00% 22 - 15.02.63	50 000	CAD	36 966	39 022	0,01
Hydro-Quebec 5.00% 06 - 15.02.45	100 000	CAD	98 161	86 273	0,01
Hydro-Quebec 5.00% 09 - 15.02.50	50 000	CAD	50 959	44 432	0,01
Hydro-Quebec 6.00% 99 - 15.08.31	20 000	CAD	19 116	17 521	0,00
Hydro-Quebec 6.00% 99 - 15.02.40	100 000	CAD	105 460	94 207	0,01
Hydro-Quebec 6.50% 99 - 15.02.35	60 000	CAD	62 065	56 309	0,01
Mercedes-Benz Finance Canada Inc. 1.65% 20 - 22.09.25	10 000	CAD	7 751	7 227	0,00
National Bank of Canada 0.01% 21 - 29.09.26	100 000	EUR	107 432	102 214	0,02
National Bank of Canada 2.237% 21 - 04.11.26	20 000	CAD	15 455	14 287	0,00
Nutrien Ltd. 4.20% 19 - 01.04.29	25 000	USD	25 874	24 609	0,00
Nutrien Ltd. 5.00% 19 - 01.04.49	25 000	USD	28 249	23 893	0,00
Nutrien Ltd. 5.95% 22 - 07.11.25	50 000	USD	50 403	50 899	0,01
Ontario Electricity Financial Corp. Zero Coupon 91 - 11.04.31	70 000	CAD	42 630	40 053	0,01
Ontario Teachers' Finance Trust 0.50% 20 - 06.05.25	100 000	EUR	109 733	106 490	0,02
Pembina Pipeline Corp. 3.31% 19 - 01.02.30	10 000	CAD	7 601	7 038	0,00
Pembina Pipeline Corp. 3.53% 21 - 10.12.31	10 000	CAD	7 475	6 927	0,00
Pembina Pipeline Corp. 3.62% 19 - 03.04.29	10 000	CAD	7 804	7 240	0,00
Pembina Pipeline Corp. 4.02% 18 - 27.03.28	10 000	CAD	7 995	7 429	0,00
Pembina Pipeline Corp. 4.24% 15 - 15.06.27	10 000	CAD	8 075	7 522	0,00
Pembina Pipeline Corp. 4.49% 21 - 10.12.51	10 000	CAD	7 139	6 599	0,00
Pembina Pipeline Corp. 4.54% 19 - 03.04.49	10 000	CAD	7 238	6 680	0,00
Pembina Pipeline Corp. 4.74% 17 - 21.01.47	10 000	CAD	7 478	6 898	0,00
Pembina Pipeline Corp. 4.75% 18 - 26.03.48	10 000	CAD	7 479	6 902	0,00
Pembina Pipeline Corp. 4.81% 14 - 25.03.44	10 000	CAD	7 591	7 006	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Province of Alberta Canada 1.30% 20 - 22.07.30	100 000	USD	83 734	83 454	0,01
Province of Alberta Canada 1.65% 21 - 01.06.31	200 000	CAD	145 455	132 243	0,02
Province of Alberta Canada 2.05% 19 - 01.06.30	100 000	CAD	66 723	69 330	0,01
Province of Alberta Canada 2.20% 16 - 01.06.26	50 000	CAD	39 539	36 483	0,01
Province of Alberta Canada 2.55% 17 - 01.06.27	100 000	CAD	70 847	73 242	0,01
Province of Alberta Canada 2.90% 18 - 01.12.28	100 000	CAD	80 088	73 755	0,01
Province of Alberta Canada 3.10% 18 - 01.06.50	200 000	CAD	152 873	129 431	0,02
Province of Alberta Canada 3.45% 13 - 01.12.43	150 000	CAD	120 643	104 187	0,02
Province of British Columbia Canada 0.90% 21 - 20.07.26	50 000	USD	46 511	45 957	0,01
Province of British Columbia Canada 1.30% 21 - 29.01.31	200 000	USD	182 947	165 650	0,02
Province of British Columbia Canada 2.75% 21 - 18.06.52	50 000	CAD	35 915	30 408	0,00
Province of British Columbia Canada 2.80% 15 - 18.06.48	80 000	CAD	48 390	49 397	0,01
Province of British Columbia Canada 2.95% 18 - 18.06.50	150 000	CAD	86 075	94 960	0,01
Province of British Columbia Canada 3.20% 12 - 18.06.44	50 000	CAD	35 496	33 568	0,01
Province of British Columbia Canada 5.40% 04 - 18.06.35	120 000	CAD	112 793	103 900	0,02
Province of British Columbia Canada 6.35% 00 - 18.06.31	125 000	CAD	115 209	111 405	0,02
Province of Manitoba Canada 2.05% 20 - 05.09.52	80 000	CAD	39 694	40 096	0,01
Province of Manitoba Canada 2.45% 15 - 02.06.25	50 000	CAD	36 325	36 972	0,01
Province of Manitoba Canada 3.35% 12 - 05.03.43	50 000	CAD	39 177	33 842	0,01
Province of Manitoba Canada 3.40% 17 - 05.09.48	125 000	CAD	90 419	83 872	0,01
Province of New Brunswick Canada 1.80% 20 - 14.08.25	50 000	CAD	39 438	36 546	0,01
Province of New Brunswick Canada 3.10% 16 - 14.08.48	50 000	CAD	37 407	31 951	0,01
Province of New Brunswick Canada 3.10% 18 - 14.08.28	50 000	CAD	40 359	37 187	0,01
Province of New Brunswick Canada 3.95% 22 - 14.08.32	50 000	CAD	38 151	38 436	0,01
Province of New Brunswick Canada 4.80% 07 - 26.09.39	50 000	CAD	46 133	41 149	0,01
Province of Newfoundland and Labrador Canada 1.25% 20 - 02.06.27	30 000	CAD	22 756	20 974	0,00
Province of Newfoundland and Labrador Canada 2.05% 21 - 02.06.31	50 000	CAD	35 933	33 649	0,01
Province of Newfoundland and Labrador Canada 2.65% 19 - 17.10.50	25 000	CAD	16 668	13 970	0,00
Province of Newfoundland and Labrador Canada 2.85% 19 - 02.06.29	40 000	CAD	31 692	29 192	0,00
Province of Newfoundland and Labrador Canada 3.30% 15 - 17.10.46	40 000	CAD	30 102	25 651	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Province of Nova Scotia Canada 3.15% 19 - 01.12.51	160 000	CAD	101 220	103 438	0,02
Province of Nova Scotia Canada 5.80% 03 - 01.06.33	150 000	CAD	144 322	131 387	0,02
Province of Ontario Canada 0.01% 20 - 25.11.30	100 000	EUR	101 178	91 637	0,01
Province of Ontario Canada 0.25% 21 - 15.12.26	100 000	GBP	125 176	113 865	0,02
Province of Ontario Canada 1.05% 20 - 21.05.27	250 000	USD	237 377	225 477	0,03
Province of Ontario Canada 1.35% 20 - 02.12.30	150 000	CAD	94 967	98 351	0,01
Province of Ontario Canada 1.75% 20 - 08.09.25	200 000	CAD	157 561	145 911	0,02
Province of Ontario Canada 1.90% 20 - 02.12.51	300 000	CAD	178 063	150 628	0,02
Province of Ontario Canada 2.05% 20 - 02.06.30	200 000	CAD	151 177	138 677	0,02
Province of Ontario Canada 2.15% 21 - 02.06.31	150 000	CAD	112 836	102 861	0,02
Province of Ontario Canada 2.40% 16 - 02.06.26	200 000	CAD	158 895	146 657	0,02
Province of Ontario Canada 2.55% 21 - 02.12.52	100 000	CAD	55 040	58 140	0,01
Province of Ontario Canada 2.60% 15 - 02.06.25	100 000	CAD	79 961	74 116	0,01
Province of Ontario Canada 2.60% 17 - 02.06.27	250 000	CAD	182 357	183 481	0,03
Province of Ontario Canada 2.65% 19 - 02.12.50	300 000	CAD	209 753	178 856	0,03
Province of Ontario Canada 2.70% 19 - 02.06.29	150 000	CAD	111 658	109 287	0,02
Province of Ontario Canada 2.80% 16 - 02.06.48	200 000	CAD	144 278	123 645	0,02
Province of Ontario Canada 2.90% 15 - 02.12.46	240 000	CAD	145 474	152 078	0,02
Province of Ontario Canada 2.90% 17 - 02.06.49	75 000	CAD	49 813	47 110	0,01
Province of Ontario Canada 2.90% 18 - 02.06.28	175 000	CAD	140 328	129 401	0,02
Province of Ontario Canada 3.45% 13 - 02.06.45	300 000	CAD	240 352	208 842	0,03
Province of Ontario Canada 3.50% 12 - 02.06.43	250 000	CAD	182 868	176 069	0,03
Province of Ontario Canada 3.65% 23 - 02.06.33	100 000	CAD	75 103	75 180	0,01
Province of Ontario Canada 3.75% 22 - 02.06.32	150 000	CAD	117 310	114 185	0,02
Province of Ontario Canada 3.75% 22 - 02.12.53	160 000	CAD	109 748	118 116	0,02
Province of Ontario Canada 4.60% 08 - 02.06.39	250 000	CAD	227 582	203 559	0,03
Province of Ontario Canada 4.65% 10 - 02.06.41	75 000	CAD	61 235	61 423	0,01
Province of Ontario Canada 4.70% 06 - 02.06.37	150 000	CAD	113 358	122 927	0,02
Province of Ontario Canada 5.60% 04 - 02.06.35	250 000	CAD	242 921	219 714	0,03
Province of Ontario Canada 5.85% 03 - 08.03.33	50 000	CAD	42 471	43 935	0,01
Province of Ontario Canada 7.60% 96 - 02.06.27	150 000	CAD	124 611	128 122	0,02
Province of Quebec Canada 0.50% 22 - 25.01.32	100 000	EUR	102 725	92 210	0,01
Province of Quebec Canada 0.60% 20 - 23.07.25	40 000	USD	37 816	37 612	0,01
Province of Quebec Canada 0.875% 17 - 04.05.27	200 000	EUR	219 311	208 507	0,03
Province of Quebec Canada 1.50% 20 - 11.02.25	250 000	USD	242 490	241 022	0,04
Province of Quebec Canada 1.50% 21 - 01.09.31	200 000	CAD	143 349	130 297	0,02
Province of Quebec Canada 1.90% 20 - 01.09.30	250 000	CAD	177 373	171 189	0,03
Province of Quebec Canada 1.90% 21 - 21.04.31	200 000	USD	161 370	171 516	0,03
Province of Quebec Canada 2.50% 16 - 01.09.26	100 000	CAD	79 644	73 533	0,01
Province of Quebec Canada 2.50% 16 - 20.04.26	160 000	USD	152 562	153 598	0,02
Province of Quebec Canada 2.75% 15 - 01.09.25	100 000	CAD	71 765	74 199	0,01
Province of Quebec Canada 2.75% 17 - 01.09.27	200 000	CAD	143 791	147 667	0,02
Province of Quebec Canada 2.75% 17 - 12.04.27	200 000	USD	200 912	191 126	0,03
Province of Quebec Canada 2.75% 18 - 01.09.28	100 000	CAD	79 711	73 445	0,01
Province of Quebec Canada 2.85% 21 - 01.12.53	170 000	CAD	123 725	105 397	0,02
Province of Quebec Canada 3.10% 19 - 01.12.51	200 000	CAD	120 932	130 755	0,02
Province of Quebec Canada 3.50% 13 - 01.12.45	25 000	CAD	16 781	17 568	0,00
Province of Quebec Canada 3.50% 15 - 01.12.48	250 000	CAD	203 240	175 428	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Province of Quebec Canada 3.60% 23 - 01.09.33	120 000	CAD	84 918	89 962	0,01
Province of Quebec Canada 4.25% 11 - 01.12.43	50 000	CAD	37 446	39 147	0,01
Province of Quebec Canada 4.40% 22 - 01.12.55	100 000	CAD	83 039	82 999	0,01
Province of Quebec Canada 5.00% 06 - 01.12.38	100 000	CAD	81 065	84 912	0,01
Province of Quebec Canada 5.00% 09 - 01.12.41	100 000	CAD	80 537	85 427	0,01
Province of Quebec Canada 5.75% 03 - 01.12.36	100 000	CAD	86 112	90 046	0,01
Province of Quebec Canada 6.25% 00 - 01.06.32	150 000	CAD	129 628	134 321	0,02
Province of Quebec Canada 7.50% 99 - 15.09.29	100 000	USD	117 033	116 771	0,02
Province of Saskatchewan Canada 2.55% 16 - 02.06.26	40 000	CAD	31 888	29 422	0,00
Province of Saskatchewan Canada 3.05% 18 - 02.12.28	100 000	CAD	80 566	74 217	0,01
Province of Saskatchewan Canada 3.10% 18 - 02.06.50	100 000	CAD	62 303	64 819	0,01
Province of Saskatchewan Canada 3.90% 13 - 02.06.45	150 000	CAD	128 006	111 243	0,02
PSP Capital Inc. 0.90% 20 - 15.06.26	150 000	CAD	114 931	105 918	0,02
Rogers Communications Inc. 3.65% 20 - 31.03.27	50 000	CAD	35 557	36 991	0,01
Rogers Communications Inc. 4.25% 22 - 15.04.32	100 000	CAD	69 740	73 056	0,01
Rogers Communications Inc. 4.55% 23 - 15.03.52	185 000	USD	152 003	161 758	0,02
Rogers Communications Inc. 6.75% 09 - 09.11.39	60 000	CAD	47 755	52 111	0,01
Royal Bank of Canada 0.625% 22 - 23.03.26	100 000	EUR	105 323	104 976	0,02
Royal Bank of Canada 0.875% 21 - 20.01.26	50 000	USD	45 215	46 378	0,01
Royal Bank of Canada 1.15% 20 - 10.06.25	25 000	USD	24 355	23 710	0,00
Royal Bank of Canada 1.15% 21 - 14.07.26	105 000	USD	99 934	96 088	0,01
Royal Bank of Canada 1.40% 21 - 02.11.26	50 000	USD	44 712	45 760	0,01
Royal Bank of Canada 1.589% 21 - 04.05.26	20 000	CAD	15 344	14 272	0,00
Royal Bank of Canada 1.60% 22 - 21.01.25	80 000	USD	76 684	77 104	0,01
Royal Bank of Canada FRN 21 - 28.01.33	60 000	CAD	40 788	40 595	0,01
Royal Bank of Canada 1.833% 21 - 31.07.28	60 000	CAD	39 734	41 105	0,01
Royal Bank of Canada 1.936% 20 - 01.05.25	20 000	CAD	15 698	14 620	0,00
Royal Bank of Canada FRN 20 - 30.06.30	20 000	CAD	15 393	14 534	0,00
Royal Bank of Canada FRN 21 - 03.11.31	20 000	CAD	15 043	14 076	0,00
Royal Bank of Canada 2.30% 21 - 03.11.31	80 000	USD	71 344	67 622	0,01
Royal Bank of Canada 2.328% 20 - 28.01.27	25 000	CAD	19 343	17 866	0,00
Royal Bank of Canada 2.375% 22 - 13.09.27	100 000	EUR	104 784	108 514	0,02
Royal Bank of Canada FRN 19 - 23.12.29	20 000	CAD	15 778	14 787	0,00
Royal Bank of Canada FRN 22 - 03.05.32	10 000	CAD	7 698	7 128	0,00
Royal Bank of Canada 3.369% 22 - 29.09.25	50 000	CAD	38 583	37 087	0,01
Royal Bank of Canada 3.375% 22 - 14.04.25	50 000	USD	48 487	49 031	0,01
Royal Bank of Canada 3.50% 23 - 25.07.28	100 000	EUR	109 699	113 410	0,02
Royal Bank of Canada 4.632% 23 - 01.05.28	40 000	CAD	29 671	30 595	0,00
Royal Bank of Canada 4.642% 23 - 17.01.28	50 000	CAD	36 773	38 226	0,01
Royal Bank of Canada 4.93% 10 - 16.07.25	10 000	CAD	8 241	7 628	0,00
Saputo Inc. 2.242% 20 - 16.06.27	10 000	CAD	7 591	7 069	0,00
Sun Life Financial Inc. FRN 20 - 10.05.32	50 000	CAD	33 554	35 461	0,01
Sun Life Financial Inc. FRN 21 - 21.11.33	40 000	CAD	30 252	27 876	0,00
Sysco Canada Inc. 3.65% 18 - 25.04.25	10 000	CAD	8 006	7 459	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
TELUS Corp. 2.05% 20 - 07.10.30	10 000	CAD	7 079	6 511	0,00
TELUS Corp. 2.35% 20 - 27.01.28	10 000	CAD	7 598	7 035	0,00
TELUS Corp. 2.75% 19 - 08.07.26	10 000	CAD	7 849	7 303	0,00
TELUS Corp. 2.85% 21 - 13.11.31	10 000	CAD	7 336	6 697	0,00
TELUS Corp. 3.15% 19 - 19.02.30	10 000	CAD	7 657	7 036	0,00
TELUS Corp. 3.30% 19 - 02.05.29	10 000	CAD	7 778	7 188	0,00
TELUS Corp. 3.625% 18 - 01.03.28	10 000	CAD	7 967	7 377	0,00
TELUS Corp. 3.75% 14 - 17.01.25	30 000	CAD	22 157	22 437	0,00
TELUS Corp. 3.75% 15 - 10.03.26	10 000	CAD	8 034	7 472	0,00
TELUS Corp. 3.95% 19 - 16.02.50	10 000	CAD	6 975	6 253	0,00
TELUS Corp. 4.10% 21 - 05.04.51	10 000	CAD	7 142	6 401	0,00
TELUS Corp. 4.40% 13 - 01.04.43	10 000	CAD	7 602	6 818	0,00
TELUS Corp. 4.40% 15 - 29.01.46	10 000	CAD	7 537	6 795	0,00
TELUS Corp. 4.60% 18 - 16.11.48	25 000	USD	26 900	22 365	0,00
TELUS Corp. 4.85% 14 - 05.04.44	10 000	CAD	8 009	7 227	0,00
Thomson Reuters Corp. 2.239% 20 - 14.05.25	20 000	CAD	15 754	14 659	0,00
Toromont Industries Ltd. 3.842% 17 - 27.10.27	10 000	CAD	8 030	7 445	0,00
Toronto-Dominion Bank 0.75% 21 - 06.01.26	55 000	USD	52 534	50 813	0,01
Toronto-Dominion Bank 0.864% 22 - 24.03.27	100 000	EUR	100 937	103 532	0,02
Toronto-Dominion Bank 1.128% 20 - 09.12.25	25 000	CAD	19 144	17 813	0,00
Toronto-Dominion Bank 1.15% 20 - 12.06.25	100 000	USD	94 690	94 688	0,01
Toronto-Dominion Bank 1.20% 21 - 03.06.26	70 000	USD	66 935	64 289	0,01
Toronto-Dominion Bank 1.888% 21 - 08.03.28	25 000	CAD	18 721	17 295	0,00
Toronto-Dominion Bank 1.896% 21 - 11.09.28	25 000	CAD	18 555	17 131	0,00
Toronto-Dominion Bank 2.00% 21 - 10.09.31	100 000	USD	90 530	83 293	0,01
Toronto-Dominion Bank 2.26% 22 - 07.01.27	50 000	CAD	34 306	35 683	0,01
Toronto-Dominion Bank 2.45% 22 - 12.01.32	50 000	USD	41 765	42 022	0,01
Toronto-Dominion Bank 2.496% 19 - 02.12.24	100 000	CAD	79 379	74 052	0,01
Toronto-Dominion Bank 2.551% 22 - 03.08.27	100 000	EUR	102 169	108 078	0,02
Toronto-Dominion Bank FRN 19 - 26.01.32	25 000	CAD	19 406	17 991	0,00
Toronto-Dominion Bank FRN 20 - 22.04.30	25 000	CAD	19 760	18 446	0,00
Toronto-Dominion Bank 3.766% 22 - 06.06.25	50 000	USD	48 512	49 195	0,01
Toronto-Dominion Bank 3.879% 23 - 13.03.26	100 000	EUR	110 379	112 481	0,02
Toronto-Dominion Bank 4.21% 22 - 01.06.27	60 000	CAD	43 715	45 179	0,01
Toronto-Dominion Bank 4.50% 22 - 28.07.25	200 000	AUD	137 602	136 419	0,02
Toronto-Dominion Bank 4.68% 22 - 08.01.29	50 000	CAD	37 869	38 382	0,01
Toronto-Dominion Bank FRN 16 - 04.03.31	25 000	CAD	20 690	18 986	0,00
Toronto-Dominion Bank 144A 3.815% 22 - 25.07.25	150 000	USD	146 258	147 643	0,02
Waste Connections Inc. 2.95% 21 - 15.01.52	50 000	USD	42 082	35 378	0,01
Waste Management of Canada Corp. 2.60% 19 - 23.09.26	10 000	CAD	7 832	7 268	0,00
WSP Global Inc. 2.408% 21 - 19.04.28	10 000	CAD	7 558	7 003	0,00
			28 150 935	27 083 769	3,96
Îles Caïmans					
Alibaba Group Holdings Ltd. 2.125% 21 - 09.02.31	25 000	USD	22 316	20 736	0,00
Alibaba Group Holdings Ltd. 2.70% 21 - 09.02.41	50 000	USD	39 121	34 304	0,01
Alibaba Group Holdings Ltd. 3.40% 17 - 06.12.27	50 000	USD	49 439	47 439	0,01
Alibaba Group Holdings Ltd. 4.20% 17 - 06.12.47	75 000	USD	70 580	61 346	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Îles Caïmans (suite)					
Alibaba Group Holdings Ltd. 4.40% 17 - 06.12.57	50 000	USD	47 518	40 723	0,01
Alibaba Group Holdings Ltd. 4.50% 15 - 28.11.34	25 000	USD	25 043	23 515	0,00
Baidu Inc. 1.72% 20 - 09.04.26	25 000	USD	23 965	23 220	0,00
Baidu Inc. 2.375% 21 - 23.08.31	25 000	USD	22 500	20 697	0,00
			300 482	271 980	0,04
Chili					
Banco Santander Chile 3.177% 21 - 26.10.31	50 000	USD	48 177	43 386	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 2.50% 20 - 01.03.25	40 000 000	CLP	43 577	44 329	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.50% 15 - 01.03.26	60 000 000	CLP	72 433	67 597	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.00% 15 - 01.03.35	55 000 000	CLP	64 947	61 661	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.10% 19 - 15.07.50	35 000 000	CLP	40 125	39 940	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 6.00% 13 - 01.01.43	50 000 000	CLP	63 249	62 118	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 2.30% 20 - 01.10.28	45 000 000	CLP	48 131	45 372	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 2.80% 20 - 01.10.33	65 000 000	CLP	66 747	59 959	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 4.70% 18 - 01.09.30	80 000 000	CLP	93 475	88 442	0,01
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 5.00% 21 - 01.10.28	60 000 000	CLP	71 565	67 811	0,01
Chile 1.25% 20 - 29.01.40	100 000	EUR	93 766	77 131	0,01
Chile 2.55% 21 - 27.07.33	150 000	USD	138 359	123 958	0,02
Chile 3.125% 16 - 21.01.26	30 000	USD	29 290	29 080	0,00
Chile 3.25% 21 - 21.09.71	240 000	USD	188 648	160 382	0,02
Chile 4.34% 22 - 07.03.42	80 000	USD	71 171	71 478	0,01
Chile 4.95% 23 - 05.01.36	100 000	USD	98 260	98 872	0,01
Corp Nacional del Cobre de Chile 3.70% 19 - 30.01.50	90 000	USD	80 626	64 786	0,01
Corp Nacional del Cobre de Chile 4.375% 19 - 05.02.49	160 000	USD	135 054	129 123	0,02
Corp Nacional del Cobre de Chile 5.125% 23 - 02.02.33	150 000	USD	149 311	145 074	0,02
Corp Nacional del Cobre de Chile 6.30% 23 - 08.09.53	200 000	USD	191 518	202 254	0,03
			1 788 429	1 682 753	0,25
Chine					
Bank of China Ltd. 1.25% 20 - 24.06.25	300 000	USD	293 375	284 412	0,04
			293 375	284 412	0,04
Colombie					
Colombia 5.75% 20 - 03.11.27	450 000 000	COP	98 185	102 731	0,02
Colombia 6.00% 12 - 28.04.28	498 300 000	COP	114 414	113 482	0,02
Colombia 6.25% 17 - 26.11.25	189 500 000	COP	46 693	46 387	0,01
Colombia 6.25% 21 - 09.07.36	100 000 000	COP	13 714	18 802	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Colombie (suite)					
Colombia 7.00% 16 - 30.06.32	450 000 000	COP	62 968	97 379	0,02
Colombia 7.00% 21 - 26.03.31	402 000 000	COP	88 324	89 491	0,01
Colombia 7.25% 18 - 18.10.34	1 073 900 000	COP	234 363	228 266	0,03
Colombia 7.25% 20 - 26.10.50	344 800 000	COP	60 563	64 669	0,01
Colombia 7.50% 11 - 26.08.26	360 000 000	COP	82 727	88 851	0,01
Colombia 7.75% 14 - 18.09.30	352 900 000	COP	83 387	82 894	0,01
Colombia 9.25% 22 - 28.05.42	76 000 000	COP	17 180	17 798	0,00
Colombia 9.85% 07 - 28.06.27	20 000 000	COP	3 981	4 972	0,00
Colombia 13.25% 23 - 09.02.33	240 000 000	COP	60 325	73 758	0,01
			966 824	1 029 480	0,15
Croatie					
Croatia 1.50% 20 - 17.06.31	100 000	EUR	104 912	99 221	0,01
Croatia 3.00% 15 - 11.03.25	120 000	EUR	131 304	132 094	0,02
Croatia 3.75% 23 - 24.11.33	100 000	EUR	109 760	114 939	0,02
			345 976	346 254	0,05
Chypre					
Cyprus 0.95% 22 - 20.01.32	100 000	EUR	102 121	95 218	0,01
Cyprus 4.25% 15 - 04.11.25	50 000	EUR	58 659	56 804	0,01
			160 780	152 022	0,02
République tchèque					
Czech Republic 0.05% 20 - 29.11.29	2 500 000	CZK	87 705	90 320	0,01
Czech Republic 0.25% 17 - 10.02.27	3 000 000	CZK	113 374	119 718	0,02
Czech Republic 1.00% 15 - 26.06.26	2 200 000	CZK	87 869	91 130	0,01
Czech Republic 1.20% 20 - 13.03.31	4 500 000	CZK	167 194	169 523	0,03
Czech Republic 1.25% 20 - 14.02.25	4 000 000	CZK	172 186	172 062	0,03
Czech Republic 1.50% 20 - 24.04.40	800 000	CZK	23 497	25 544	0,00
Czech Republic 1.75% 21 - 23.06.32	3 000 000	CZK	110 033	115 393	0,02
Czech Republic 2.40% 14 - 17.09.25	1 000 000	CZK	43 445	43 191	0,01
Czech Republic 2.50% 13 - 25.08.28	2 000 000	CZK	83 256	84 794	0,01
Czech Republic 2.75% 18 - 23.07.29	2 000 000	CZK	83 913	84 899	0,01
Czech Republic 3.50% 22 - 30.05.35	500 000	CZK	21 301	21 708	0,00
Czech Republic 4.20% 06 - 04.12.36	5 000 000	CZK	227 172	232 255	0,03
Czech Republic 4.85% 07 - 26.11.57	200 000	CZK	9 419	10 064	0,00
Czech Republic 5.00% 22 - 30.09.30	2 000 000	CZK	77 265	96 134	0,01
Czech Republic 5.50% 22 - 12.12.28	1 000 000	CZK	47 392	48 463	0,01
Czech Republic 6.00% 22 - 26.02.26	1 000 000	CZK	40 305	46 531	0,01
			1 395 326	1 451 729	0,21
Danemark					
Danske Bank A/S FRN 21 - 15.05.31	100 000	EUR	105 286	103 073	0,02
Danske Bank A/S 144A 4.375% 18 - 12.06.28	10 000	USD	10 068	9 671	0,00
Denmark Zero Coupon 21 - 15.11.31	1 640 000	DKK	208 144	205 794	0,03
Denmark Zero Coupon 22 - 15.11.31	500 000	DKK	54 785	62 797	0,01
Denmark 0.25% 20 - 15.11.52	786 000	DKK	92 108	66 356	0,01
Denmark 0.50% 17 - 15.11.27	1 096 000	DKK	156 611	152 985	0,02
Denmark 0.50% 19 - 15.11.29	1 150 000	DKK	168 954	155 726	0,02
Denmark 1.75% 14 - 15.11.25	500 000	DKK	76 048	73 159	0,01
Denmark 2.25% 23 - 15.11.33	500 000	DKK	70 992	74 060	0,01
Denmark 4.50% 08 - 15.11.39	1 860 000	DKK	406 002	351 984	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Danemark (suite)					
Jyske Bank A/S FRN 21 - 17.02.28	100 000	EUR	105 508	100 265	0,01
Kommunekredit 0.50% 18 - 24.01.25	200 000	EUR	219 467	214 728	0,03
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1.00% 20 - 01.04.26	800 000	DKK	118 581	114 184	0,02
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1.00% 21 - 01.10.26	500 000	DKK	69 852	70 943	0,01
Nykredit Realkredit AS 0.375% 21 - 17.01.28	100 000	EUR	103 204	97 283	0,01
Nykredit Realkredit AS 2.00% 15 - 01.01.26	1 000 000	DKK	151 333	145 936	0,02
Orsted AS 2.125% 19 - 17.05.27	100 000	GBP	116 941	117 612	0,02
Orsted AS 3.25% 22 - 13.09.31	100 000	EUR	96 136	109 490	0,02
Orsted AS 5.125% 22 - 13.09.34	100 000	GBP	124 935	126 900	0,02
Realkredit Danmark A/S 1.00% 14 - 01.01.25	550 000	DKK	81 723	79 700	0,01
Realkredit Danmark A/S 1.00% 14 - 01.01.26	569 000	DKK	84 417	81 446	0,01
Sydbank AS FRN 21 - 10.11.26	100 000	EUR	107 025	103 607	0,02
Vestas Wind Systems A/S 4.125% 23 - 15.06.31	100 000	EUR	108 828	114 000	0,02
			2 836 948	2 731 699	0,40
Finlande					
Finland 144A Zero Coupon 20 - 15.09.30	59 000	EUR	61 693	55 708	0,01
Finland 144A Zero Coupon 21 - 15.09.26	50 000	EUR	54 431	51 883	0,01
Finland 144A 0.125% 20 - 15.04.36	90 000	EUR	88 573	72 797	0,01
Finland 144A 0.125% 21 - 15.04.52	44 000	EUR	37 561	24 050	0,00
Finland 144A 0.125% 21 - 15.09.31	120 000	EUR	124 906	111 119	0,02
Finland 144A 0.25% 20 - 15.09.40	60 000	EUR	49 187	44 035	0,01
Finland 144A 0.50% 16 - 15.04.26	100 000	EUR	100 728	105 874	0,02
Finland 144A 0.50% 17 - 15.09.27	60 000	EUR	63 236	62 247	0,01
Finland 144A 0.50% 18 - 15.09.28	120 000	EUR	131 566	122 085	0,02
Finland 144A 0.50% 19 - 15.09.29	68 000	EUR	74 139	67 991	0,01
Finland 144A 0.50% 22 - 15.04.43	60 000	EUR	41 794	43 516	0,01
Finland 144A 0.875% 15 - 15.09.25	80 000	EUR	89 160	85 972	0,01
Finland 144A 1.375% 17 - 15.04.47	46 000	EUR	54 775	38 662	0,01
Finland 144A 1.50% 22 - 15.09.32	120 000	EUR	115 371	122 266	0,02
Finland 144A 2.625% 12 - 04.07.42	40 000	EUR	46 787	43 024	0,01
Finland 144A 2.75% 12 - 04.07.28	70 000	EUR	77 287	78 957	0,01
Finland 144A 2.75% 23 - 15.04.38	32 000	EUR	33 790	35 273	0,00
Finland 144A 2.875% 23 - 15.04.29	50 000	EUR	54 903	56 779	0,01
Finland 144A 3.00% 23 - 15.09.33	130 000	EUR	141 422	148 951	0,02
Finland 144A 4.00% 09 - 04.07.25	50 000	EUR	55 993	56 315	0,01
Finnvera OYJ 1.125% 17 - 17.05.32	100 000	EUR	110 031	98 733	0,01
Kuntarahoitus OYJ 0.25% 22 - 25.02.32	150 000	EUR	131 228	137 360	0,02
Nordea Bank Abp FRN 23 - 10.02.26	150 000	EUR	161 457	165 268	0,02
Nordea Bank Abp 144A 1.50% 21 - 30.09.26	25 000	USD	23 744	22 796	0,00
Nordea Kiinnitysluottopankki OYJ 1.375% 18 - 28.02.33	100 000	EUR	111 928	97 552	0,01
OP Corporate Bank PLC 0.375% 21 - 16.06.28	100 000	EUR	103 448	97 378	0,01
OP Mortgage Bank 0.01% 20 - 19.11.30	100 000	EUR	102 319	91 341	0,01
Sampo OYJ FRN 19 - 23.05.49	100 000	EUR	94 024	103 972	0,02
			2 335 481	2 241 904	0,33

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Aéroports de Paris 1.125% 19 - 18.06.34	100 000	EUR	85 661	89 977	0,01
Aéroports de Paris 1.50% 20 - 02.07.32	100 000	EUR	96 214	97 052	0,01
Agence Francaise de Developpement Epic Zero Coupon 20 - 25.03.25	100 000	EUR	105 801	106 270	0,02
Agence Francaise de Developpement Epic 0.50% 18 - 31.10.25	100 000	EUR	101 791	105 870	0,02
Agence Francaise de Developpement Epic 0.50% 19 - 31.05.35	100 000	EUR	99 937	84 555	0,01
Agence Francaise de Developpement Epic 1.25% 22 - 18.06.25	200 000	GBP	246 872	242 197	0,04
Agence Francaise de Developpement Epic 1.375% 22 - 21.01.25	200 000	USD	197 831	192 688	0,03
Agence Francaise de Developpement EPIC 1.125% 22 - 02.03.37	200 000	EUR	165 195	174 086	0,03
APRR SA 1.25% 16 - 06.01.27	100 000	EUR	110 464	105 368	0,02
Arkea Home Loans SFH SA 1.50% 18 - 01.06.33	100 000	EUR	86 149	97 903	0,01
Arkema SA 0.75% 19 - 03.12.29	100 000	EUR	93 235	96 544	0,01
Arval Service Lease SA 0.875% 22 - 17.02.25	100 000	EUR	111 044	106 794	0,02
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 27.06.28	100 000	EUR	110 694	104 119	0,02
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 19 - 21.02.31	100 000	EUR	109 273	99 261	0,01
AXA SA FRN 18 - 28.05.49	100 000	EUR	113 947	105 929	0,02
AXA SA FRN 22 - 10.03.43	100 000	EUR	98 950	109 073	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 21 - 11.05.26	100 000	EUR	106 859	102 642	0,01
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 21 - 19.07.28	100 000	EUR	102 691	95 623	0,01
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 22 - 19.11.27	100 000	EUR	99 037	99 396	0,01
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 20 - 03.06.30	100 000	EUR	90 031	95 505	0,01
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.875% 23 - 26.01.28	100 000	EUR	108 135	112 094	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 22 - 21.11.29	100 000	EUR	107 634	114 414	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 5.125% 23 - 13.01.33	100 000	EUR	108 302	118 266	0,02
BNP Paribas SA FRN 21 - 19.01.30	100 000	EUR	89 172	94 737	0,01
BNP Paribas SA 0.625% 20 - 03.12.32	100 000	EUR	97 744	86 054	0,01
BNP Paribas SA 1.125% 18 - 11.06.26	100 000	EUR	101 073	105 154	0,02
BNP Paribas SA 1.625% 19 - 02.07.31	100 000	EUR	103 775	94 337	0,01
BNP Paribas SA 2.00% 21 - 13.09.36	100 000	GBP	69 784	94 704	0,01
BNP Paribas SA FRN 19 - 23.01.27	100 000	EUR	111 484	107 321	0,02
BNP Paribas SA FRN 22 - 25.07.28	100 000	EUR	107 016	107 566	0,02
Bouygues SA 1.125% 20 - 24.07.28	100 000	EUR	108 404	102 936	0,01
Bouygues SA 4.625% 22 - 07.06.32	100 000	EUR	113 814	121 354	0,02
BPCE SA 0.25% 21 - 14.01.31	100 000	EUR	98 880	88 935	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 FRN 22 - 14.01.28	100 000	EUR	97 799	100 830	0,01
BPCE SA 3.50% 23 - 25.01.28	100 000	EUR	107 720	111 685	0,02
BPCE SA FRN 23 - 25.01.35	100 000	EUR	107 976	113 611	0,02
BPCE SFH SA 0.01% 20 - 23.03.28	100 000	EUR	105 712	98 451	0,01
BPCE SFH SA 0.125% 21 - 03.12.30	100 000	EUR	90 975	92 097	0,01
BPCE SFH SA 0.50% 20 - 23.01.35	100 000	EUR	100 675	85 002	0,01
BPCE SFH SA 3.125% 22 - 24.01.28	100 000	EUR	99 049	112 010	0,02
BPCE SFH SA 3.125% 23 - 20.07.27	100 000	EUR	107 935	111 907	0,02
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale Zero Coupon 20 - 25.11.30	100 000	EUR	102 296	92 827	0,01
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale Zero Coupon 20 - 25.02.28	100 000	EUR	98 412	99 641	0,01
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale Zero Coupon 20 - 25.02.26	200 000	EUR	217 419	208 805	0,03
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale Zero Coupon 21 - 25.05.29	200 000	EUR	209 616	193 254	0,03
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.125% 21 - 15.09.31	100 000	EUR	101 998	91 667	0,01
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.45% 22 - 19.01.32	100 000	EUR	104 469	93 261	0,01
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.60% 22 - 25.11.29	100 000	EUR	101 324	98 879	0,01
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1.50% 22 - 25.05.32	100 000	EUR	103 993	101 222	0,01
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3.00% 23 - 25.05.28	100 000	EUR	107 975	112 684	0,02
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 144A 1.25% 21 - 28.10.26	300 000	USD	285 768	276 564	0,04
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 144A 1.375% 21 - 20.01.31	100 000	USD	81 848	83 079	0,01
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 144A 2.125% 22 - 26.01.32	200 000	USD	177 616	172 130	0,03
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 0.01% 19 - 27.11.26	100 000	EUR	107 368	102 251	0,01
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 3.125% 23 - 23.02.33	100 000	EUR	102 888	112 442	0,02
Caisse des Depots et Consignations 3.00% 23 - 25.05.28	100 000	EUR	107 095	112 776	0,02
Caisse des Depots et Consignations 3.375% 23 - 25.11.30	100 000	EUR	105 599	115 900	0,02
Caisse Francaise de Financement Local 3.125% 22 - 16.11.27	100 000	EUR	109 556	112 014	0,02
Caisse Francaise de Financement Local 3.25% 22 - 19.02.29	100 000	EUR	108 763	112 911	0,02
Caisse Francaise de Financement Local 3.50% 23 - 16.03.32	100 000	EUR	110 159	115 591	0,02
Carrefour SA 1.00% 19 - 17.05.27	100 000	EUR	107 218	103 190	0,01
Cie de Financement Foncier SA 0.01% 21 - 16.04.29	100 000	EUR	104 250	95 706	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 de Financement Foncier SA 0.01% 21 - 15.07.26	100 000	EUR	107 757	102 974	0,01
Cie de Financement Foncier SA 1.125% 15 - 24.06.25	100 000	EUR	110 992	107 310	0,02
Cie de Financement Foncier SA 4.00% 10 - 24.10.25	100 000	EUR	116 741	112 406	0,02
Cie de Saint-Gobain 1.375% 17 - 14.06.27	100 000	EUR	105 799	104 758	0,02
Cie de Saint-Gobain SA 3.75% 23 - 29.11.26	100 000	EUR	109 624	112 309	0,02
Cie de Saint-Gobain SA 3.875% 23 - 29.11.30	100 000	EUR	109 647	114 151	0,02
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA Zero Coupon 20 - 02.11.28	100 000	EUR	103 570	97 433	0,01
CNP Assurances FRN 14 - 05.06.45	100 000	EUR	117 154	109 985	0,02
Covivio 1.625% 20 - 23.06.30	100 000	EUR	106 320	97 926	0,01
Credit Agricole Assurances SA FRN 16 - 27.09.48	100 000	EUR	120 634	111 313	0,02
Credit Agricole Home Loan SFH SA 0.01% 20 - 03.11.31	200 000	EUR	200 936	177 142	0,03
Credit Agricole Home Loan SFH SA 1.00% 19 - 16.01.29	100 000	EUR	109 994	101 425	0,01
Credit Agricole Home Loan SFH SA 3.25% 23 - 28.09.32	100 000	EUR	108 871	113 524	0,02
Credit Agricole Home Loan SFH SA 3.375% 23 - 04.09.28	100 000	EUR	108 389	113 303	0,02
Credit Agricole SA 1.00% 19 - 03.07.29	100 000	EUR	106 850	98 448	0,01
Credit Agricole SA 1.125% 22 - 24.02.29	100 000	EUR	101 111	100 617	0,01
Credit Agricole SA 1.375% 18 - 13.03.25	100 000	EUR	110 402	107 727	0,02
Credit Agricole SA FRN 21 - 09.12.31	100 000	GBP	123 975	113 639	0,02
Credit Agricole SA 1.875% 16 - 20.12.26	100 000	EUR	111 135	106 346	0,02
Credit Agricole SA 3.375% 22 - 28.07.27	100 000	EUR	102 734	111 238	0,02
Credit Agricole SA 4.00% 23 - 18.01.33	100 000	EUR	109 355	116 178	0,02
Credit Agricole SA 144A 4.375% 15 - 17.03.25	25 000	USD	25 110	24 585	0,00
Credit Mutuel Arkea SA 4.125% 23 - 01.02.34	100 000	EUR	109 964	116 127	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 4.25% 22 - 01.12.32	100 000	EUR	105 054	116 101	0,02
Credit Mutuel Home Loan SFH SA 0.125% 20 - 09.04.25	100 000	EUR	109 306	106 196	0,02
Credit Mutuel Home Loan SFH SA 1.00% 19 - 30.01.29	100 000	EUR	110 077	101 543	0,01
Credit Mutuel Home Loan SFH SA 3.125% 23 - 22.06.27	100 000	EUR	107 993	111 930	0,02
Danone SA 0.52% 21 - 09.11.30	100 000	EUR	103 956	93 762	0,01
ELO SACA 2.875% 20 - 29.01.26	100 000	EUR	110 618	107 429	0,02
EssilorLuxottica SA 0.375% 19 - 27.11.27	100 000	EUR	106 976	101 038	0,01
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	509 000	EUR	559 315	543 082	0,08
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	564 000	EUR	584 195	546 665	0,08
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	490 000	EUR	511 828	514 853	0,08
France OAT Zero Coupon 20 - 25.11.30	629 000	EUR	623 539	594 180	0,09
France OAT Zero Coupon 21 - 25.11.31	618 000	EUR	583 846	567 015	0,08
France OAT Zero Coupon 21 - 25.02.27	486 000	EUR	513 800	500 649	0,07
France OAT Zero Coupon 22 - 25.05.32	410 000	EUR	371 712	370 464	0,05
France OAT Zero Coupon 22 - 25.02.25	310 000	EUR	315 419	331 340	0,05
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	430 000	EUR	471 189	448 647	0,07
France OAT 0.50% 15 - 25.05.25	611 000	EUR	666 855	654 929	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.50% 16 - 25.05.26	619 000	EUR	654 950	654 820	0,10
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	725 000	EUR	751 166	731 172	0,11
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	680 000	EUR	731 139	705 499	0,10
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	749 000	EUR	788 281	771 576	0,11
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	365 000	EUR	329 994	231 278	0,03
France OAT 0.75% 22 - 25.02.28	560 000	EUR	548 226	582 942	0,09
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	453 000	EUR	497 990	487 176	0,07
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	572 000	EUR	615 484	606 529	0,09
France OAT 1.25% 18 - 25.05.34	571 000	EUR	583 491	554 383	0,08
France OAT 1.25% 22 - 25.05.38	150 000	EUR	131 638	134 871	0,02
France OAT 1.50% 15 - 25.05.31	739 000	EUR	797 680	770 695	0,11
France OAT 2.00% 22 - 25.11.32	500 000	EUR	494 366	531 950	0,08
France OAT 2.50% 14 - 25.05.30	734 000	EUR	830 755	821 135	0,12
France OAT 2.50% 23 - 24.09.26	510 000	EUR	543 343	565 732	0,08
France OAT 2.75% 12 - 25.10.27	638 000	EUR	737 445	717 890	0,10
France OAT 2.75% 23 - 25.02.29	388 000	EUR	420 636	438 929	0,06
France OAT 3.00% 23 - 25.05.33	370 000	EUR	400 741	425 196	0,06
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	320 000	EUR	443 631	368 960	0,05
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	480 000	EUR	568 481	543 764	0,08
France OAT 3.50% 23 - 25.11.33	225 000	EUR	255 193	268 800	0,04
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	362 000	EUR	498 840	457 463	0,07
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	248 000	EUR	390 174	328 158	0,05
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	409 000	EUR	616 990	551 022	0,08
France OAT 4.75% 04 - 25.04.35	315 000	EUR	454 665	418 897	0,06
France OAT 5.50% 98 - 25.04.29	431 000	EUR	597 600	551 900	0,08
France OAT 5.75% 01 - 25.10.32	440 000	EUR	645 959	610 872	0,09
France OAT 6.00% 94 - 25.10.25	306 000	EUR	368 990	358 686	0,05
France OAT 144A 0.50% 20 - 25.05.40	258 000	EUR	224 281	197 417	0,03
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.05.72	141 000	EUR	78 866	65 355	0,01
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.06.44	270 000	EUR	186 802	186 941	0,03
France OAT 144A 0.75% 21 - 25.05.53	404 000	EUR	296 574	250 710	0,04
France OAT 144A 1.25% 16 - 25.05.36	545 000	EUR	568 069	509 411	0,07
France OAT 144A 1.50% 19 - 25.05.50	383 000	EUR	357 066	307 474	0,04
France OAT 144A 1.75% 16 - 25.05.66	220 000	EUR	188 124	174 043	0,03
France OAT 144A 1.75% 17 - 25.06.39	449 000	EUR	466 671	431 376	0,06
France OAT 144A 2.00% 17 - 25.05.48	336 000	EUR	367 540	307 115	0,04
France OAT 144A 2.50% 22 - 25.05.43	150 000	EUR	132 712	154 231	0,02
France OAT 144A 3.00% 23 - 25.05.54	210 000	EUR	209 445	227 966	0,03
France OAT 144A 4.00% 05 - 25.04.55	244 000	EUR	424 716	318 528	0,05
Gecina SA 1.625% 19 - 29.05.34	100 000	EUR	107 189	95 987	0,01
Gestion Securite de Stocks Securite SA 3.375% 23 - 29.06.30	100 000	EUR	109 460	114 367	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.475% 22 - 18.01.31	100 000	EUR	87 228	94 694	0,01
HSBC SFH France SA 0.50% 18 - 17.04.25	100 000	EUR	109 889	106 611	0,02
ICADE 0.625% 21 - 18.01.31	100 000	EUR	82 117	87 069	0,01
JCDecaux SE 2.625% 20 - 24.04.28	100 000	EUR	111 966	108 204	0,02
Klepierre SA 0.875% 20 - 17.02.31	100 000	EUR	100 487	91 889	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
La Banque Postale Home Loan SFH SA 0.01% 19 - 22.10.29	100 000	EUR	103 553	94 353	0,01
La Banque Postale Home Loan SFH SA 3.00% 23 - 31.01.31	100 000	EUR	108 203	112 055	0,02
La Banque Postale SA 1.375% 19 - 24.04.29	100 000	EUR	100 362	100 068	0,01
La Banque Postale SA 4.00% 23 - 03.05.28	100 000	EUR	110 294	113 701	0,02
La Poste SA 0.625% 20 - 21.10.26	100 000	EUR	103 855	103 478	0,01
La Poste SA 3.75% 23 - 12.06.30	100 000	EUR	113 299	114 330	0,02
Legrand SA 0.75% 20 - 20.05.30	100 000	EUR	99 261	96 810	0,01
Orange SA Zero Coupon 21 - 29.06.26	100 000	EUR	99 303	102 860	0,01
Orange SA 0.50% 19 - 04.09.32	100 000	EUR	86 433	90 128	0,01
Orange SA 1.875% 18 - 12.09.30	100 000	EUR	112 780	103 687	0,01
Orange SA 2.00% 19 - 15.01.29	100 000	EUR	113 197	106 128	0,02
Orange SA 5.50% 14 - 06.02.44	75 000	USD	87 987	78 149	0,01
RCI Banque SA 1.75% 19 - 10.04.26	70 000	EUR	75 416	74 268	0,01
RCI Banque SA 4.50% 23 - 06.04.27	100 000	EUR	108 308	113 480	0,02
Region of Ile de France 0.50% 16 - 14.06.25	100 000	EUR	110 231	106 444	0,02
Sanofi 1.00% 18 - 21.03.26	100 000	EUR	110 611	106 129	0,02
Sanofi 1.50% 20 - 01.04.30	100 000	EUR	111 659	102 676	0,01
Sanofi 3.625% 18 - 19.06.28	25 000	USD	25 693	24 508	0,00
Schneider Electric SE 3.50% 23 - 12.06.33	100 000	EUR	108 876	114 765	0,02
SFIL SA 3.25% 23 - 25.11.30	100 000	EUR	112 470	114 083	0,02
SNCF Reseau 4.25% 11 - 07.10.26	100 000	EUR	111 717	114 968	0,02
Societe Du Grand Paris EPIC Zero Coupon 20 - 25.11.30	100 000	EUR	89 471	91 959	0,01
Societe Du Grand Paris EPIC 1.625% 22 - 08.04.42	100 000	EUR	75 259	84 913	0,01
Societe Generale SA 0.125% 21 - 18.02.28	100 000	EUR	94 183	97 567	0,01
Societe Generale SA 1.75% 19 - 22.03.29	100 000	EUR	107 731	100 387	0,01
Societe Generale SA 2.625% 15 - 27.02.25	100 000	EUR	111 466	108 842	0,02
Societe Generale SA FRN 22 - 06.12.30	100 000	EUR	107 827	112 282	0,02
Societe Generale SA 144A 5.625% 15 - 24.11.45	10 000	USD	10 424	8 757	0,00
Societe Generale SFH SA 0.01% 21 - 29.10.29	100 000	EUR	103 644	94 402	0,01
Societe Generale SFH SA 1.375% 22 - 05.05.28	100 000	EUR	106 025	104 304	0,02
Societe Generale SFH SA 3.375% 23 - 31.07.30	100 000	EUR	109 659	114 203	0,02
Societe Nationale SNCF SA 0.875% 20 - 28.02.51	100 000	EUR	85 000	57 448	0,01
Societe Nationale SNCF SA 1.00% 21 - 19.01.61	100 000	EUR	63 985	49 893	0,01
Societe Nationale SNCF SA 3.125% 22 - 02.11.27	100 000	EUR	99 345	111 980	0,02
Sodexo SA 0.75% 16 - 14.04.27	100 000	EUR	108 127	104 766	0,02
UNEDIC ASSEO Zero Coupon 20 - 25.11.28	100 000	EUR	105 780	98 006	0,01
UNEDIC ASSEO Zero Coupon 20 - 19.11.30	100 000	EUR	102 463	93 249	0,01
UNEDIC ASSEO 0.10% 20 - 25.11.26	200 000	EUR	216 055	205 913	0,03
UNEDIC ASSEO 0.25% 20 - 16.07.35	100 000	EUR	97 277	83 371	0,01
UNEDIC ASSEO 0.625% 15 - 17.02.25	100 000	EUR	110 410	107 384	0,02
UNEDIC ASSEO 1.75% 22 - 25.11.32	100 000	EUR	99 279	103 232	0,01
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.00% 16 - 28.04.36	100 000	EUR	102 236	92 128	0,01
Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN 18 - 31.12.99	100 000	EUR	105 925	97 000	0,01
			38 855 235	37 600 535	5,49

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Aareal Bank AG 2.25% 22 - 01.02.27	100 000	EUR	96 112	108 556	0,02
Aareal Bank AG 4.50% 22 - 25.07.25	100 000	EUR	107 577	110 716	0,02
Allianz SE FRN 23 - 25.07.53	100 000	EUR	113 898	120 925	0,02
Bayerische Landesbank 0.20% 22 - 20.05.30	100 000	EUR	88 749	94 991	0,01
Berlin Hyp AG 0.01% 21 - 27.01.31	10 000	EUR	10 203	9 181	0,00
Berlin Hyp AG 0.125% 21 - 18.01.30	100 000	EUR	92 916	95 327	0,01
Berlin Hyp AG 0.375% 19 - 29.05.29	50 000	EUR	53 264	49 056	0,01
Berlin Hyp AG 1.25% 22 - 25.08.25	100 000	EUR	105 665	107 437	0,02
Berlin Hyp AG 1.50% 18 - 18.04.28	100 000	EUR	108 770	101 127	0,01
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	450 000	EUR	479 764	470 588	0,07
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	400 000	EUR	403 949	398 191	0,06
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	454 000	EUR	388 563	279 753	0,04
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	350 000	EUR	377 073	344 733	0,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	260 000	EUR	273 190	277 484	0,04
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	250 000	EUR	257 002	217 622	0,03
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	250 000	EUR	272 218	256 146	0,04
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	350 000	EUR	374 996	341 810	0,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	300 000	EUR	329 860	317 775	0,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	110 000	EUR	102 836	107 532	0,02
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	100 000	EUR	102 336	106 257	0,02
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.02.31	272 000	EUR	281 148	262 808	0,04
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	350 000	EUR	332 299	367 981	0,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.05.36	269 000	EUR	270 249	227 950	0,03
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.11.28	300 000	EUR	304 606	302 468	0,04
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	114 000	EUR	84 452	70 571	0,01
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	370 000	EUR	375 494	353 891	0,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	270 000	EUR	272 781	281 497	0,04
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	320 000	EUR	219 052	188 618	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 21 - 15.08.31	140 000	EUR	125 236	133 959	0,02
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.02.32	350 000	EUR	338 657	330 775	0,05
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 16.04.27	180 000	EUR	179 920	186 247	0,03
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.10.27	340 000	EUR	333 292	366 721	0,05
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	380 000	EUR	418 861	397 540	0,06
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	400 000	EUR	403 845	410 183	0,06
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	330 000	EUR	349 208	335 992	0,05
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	340 000	EUR	362 552	365 872	0,05
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	330 000	EUR	366 402	351 276	0,05
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	400 000	EUR	436 239	419 498	0,06
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	350 000	EUR	388 675	365 197	0,05
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	460 000	EUR	498 140	495 908	0,07
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 22 - 15.05.38	230 000	EUR	212 374	216 094	0,03
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	507 000	EUR	554 483	455 181	0,07
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	50 000	EUR	50 727	54 063	0,01
Bundesrepublik Deutschland 1.70% 22 - 15.08.32	383 000	EUR	386 738	414 234	0,06
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 22 - 15.08.53	333 000	EUR	302 322	332 061	0,05
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	60 000	EUR	57 417	59 995	0,01
Bundesrepublik Deutschland 2.10% 22 - 15.11.29	270 000	EUR	284 772	301 271	0,04
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 23 - 13.04.28	254 000	EUR	278 199	283 272	0,04
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	544 000	EUR	583 696	616 187	0,09
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	50 000	EUR	54 970	56 670	0,01
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 19.10.28	343 000	EUR	373 550	386 757	0,06
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 15.11.30	100 000	EUR	109 803	113 746	0,02
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 04.07.44	333 000	EUR	442 174	380 455	0,06
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	354 000	EUR	492 837	406 383	0,06
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	220 000	EUR	231 695	242 092	0,04
Bundesrepublik Deutschland 2.60% 23 - 15.08.33	210 000	EUR	222 795	243 555	0,04
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	100 000	EUR	110 045	110 676	0,02
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	213 000	EUR	228 628	237 559	0,03
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	116 000	EUR	127 213	129 832	0,02
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 04.07.42	197 000	EUR	302 647	248 807	0,04
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 04.01.37	349 000	EUR	501 182	464 069	0,07
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 04.07.39	217 000	EUR	346 940	301 839	0,04
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 04.07.28	220 000	EUR	268 828	272 169	0,04
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 04.07.34	300 000	EUR	418 183	414 658	0,06
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	268 000	EUR	415 926	396 447	0,06
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 04.01.31	234 000	EUR	349 388	318 579	0,05
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 04.01.28	220 000	EUR	271 588	276 956	0,04
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 04.01.30	170 000	EUR	231 677	233 377	0,03
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 04.07.27	150 000	EUR	201 803	190 405	0,03
Commerzbank AG 0.375% 20 - 01.09.27	100 000	EUR	105 608	101 011	0,01
Commerzbank AG 0.875% 20 - 22.01.27	100 000	EUR	106 598	102 644	0,01
Commerzbank AG 2.875% 22 - 13.10.28	100 000	EUR	108 230	111 407	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Commerzbank AG 2.875% 23 - 28.04.26	100 000	EUR	108 322	110 798	0,02
Commerzbank AG 3.375% 23 - 12.12.25	100 000	EUR	108 361	111 492	0,02
Continental AG 2.50% 20 - 27.08.26	150 000	EUR	158 452	163 714	0,02
Deutsche Bahn Finance GmbH 1.125% 21 - 29.05.51	30 000	EUR	28 006	20 916	0,00
Deutsche Bahn Finance GmbH 1.50% 17 - 08.12.32	100 000	EUR	95 454	99 531	0,01
Deutsche Bahn Finance GMBH 0.875% 16 - 11.07.31	150 000	EUR	137 512	144 374	0,02
Deutsche Bahn Finance GMBH 1.375% 22 - 03.03.34	100 000	EUR	89 614	94 591	0,01
Deutsche Bahn Finance GMBH 3.25% 23 - 19.05.33	100 000	EUR	106 013	113 880	0,02
Deutsche Bahn Finance GMBH 4.00% 23 - 23.11.43	100 000	EUR	118 690	120 544	0,02
Deutsche Bank AG FRN 20 - 24.11.26	50 000	USD	47 834	46 869	0,01
Deutsche Bank AG FRN 21 - 16.11.27	40 000	USD	37 716	36 585	0,01
Deutsche Bank AG 3.00% 22 - 28.03.28	100 000	EUR	105 104	111 876	0,02
Deutsche Bank AG FRN 21 - 28.05.32	30 000	USD	27 311	25 082	0,00
Deutsche Bank AG FRN 20 - 18.09.31	30 000	USD	28 459	26 389	0,00
Deutsche Bank AG 4.00% 22 - 29.11.27	100 000	EUR	103 306	113 564	0,02
Deutsche Bank AG FRN 22 - 05.09.30	100 000	EUR	99 906	114 097	0,02
Deutsche Bank AG FRN 20 - 19.05.31	100 000	EUR	95 852	111 759	0,02
Deutsche Bank AG FRN 20 - 08.07.31	100 000	USD	85 027	97 661	0,01
Deutsche Bank AG FRN 23 - 18.01.29	150 000	USD	152 961	157 301	0,02
Deutsche Boerse AG 0.125% 21 - 22.02.31	100 000	EUR	100 415	91 731	0,01
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.10% 21 - 02.02.26	100 000	EUR	107 223	98 958	0,01
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.625% 18 - 30.08.27	100 000	EUR	109 021	101 800	0,01
Deutsche Post AG 0.375% 20 - 20.05.26	100 000	EUR	101 970	103 922	0,01
DZ HYP AG 0.10% 16 - 31.08.26	100 000	EUR	100 072	103 051	0,01
DZ HYP AG 0.50% 18 - 13.11.25	100 000	EUR	109 680	105 687	0,02
DZ HYP AG 1.625% 22 - 30.05.31	30 000	EUR	30 101	30 788	0,00
DZ HYP AG 3.00% 23 - 30.11.32	100 000	EUR	108 893	112 811	0,02
DZ HYP AG 3.25% 23 - 30.07.27	100 000	EUR	109 485	112 628	0,02
Free and Hanseatic City of Hamburg 0.30% 20 - 16.09.50	50 000	EUR	43 898	27 929	0,00
Free and Hanseatic City of Hamburg 1.20% 18 - 03.06.33	100 000	EUR	111 475	97 837	0,01
Free State of Bavaria 0.01% 20 - 17.01.25	100 000	EUR	96 425	106 943	0,02
Free State of Bavaria 0.01% 20 - 18.01.35	50 000	EUR	48 421	41 486	0,01
Free State of Saxony 2.875% 23 - 29.03.28	100 000	EUR	108 304	112 385	0,02
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.00% 20 - 29.05.26	100 000	EUR	99 762	103 887	0,01
Hamburg Commercial Bank AG FRN 21 - 22.09.26	100 000	EUR	107 119	101 750	0,01
Hannover Rueck SE FRN 19 - 09.10.39	100 000	EUR	99 889	93 905	0,01
HeidelbergCement AG 1.50% 16 - 07.02.25	100 000	EUR	110 533	108 399	0,02
HOCHTIEF AG 1.75% 18 - 03.07.25	100 000	EUR	95 150	107 457	0,02
Infineon Technologies AG 1.125% 20 - 24.06.26	100 000	EUR	110 257	105 100	0,02
ING-DiBa AG 1.00% 19 - 23.05.39	100 000	EUR	104 183	83 267	0,01
Investitionsbank Berlin 0.25% 22 - 03.02.32	100 000	EUR	103 894	91 805	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 06 - 18.04.36	100 000	USD	59 317	60 184	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 07 - 29.06.37	150 000	USD	90 796	85 679	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 19 - 30.09.26	120 000	EUR	130 149	123 989	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 20 - 18.02.25	120 000	EUR	131 620	128 120	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 20 - 31.03.27	200 000	EUR	215 556	204 471	0,03
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 20 - 15.09.28	100 000	EUR	92 490	98 815	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 20 - 17.09.30	50 000	EUR	51 875	46 886	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 20 - 15.12.27	50 000	EUR	53 617	50 286	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 21 - 10.01.31	100 000	EUR	103 113	92 987	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 21 - 15.06.26	80 000	EUR	86 896	83 224	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 21 - 15.06.29	100 000	EUR	105 515	96 922	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 21 - 09.11.28	70 000	EUR	74 352	68 871	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 21 - 15.09.31	100 000	EUR	90 236	91 486	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau Zero Coupon 22 - 30.04.27	100 000	EUR	98 288	102 049	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 19 - 05.05.27	180 000	EUR	194 011	183 767	0,03
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.05% 19 - 29.09.34	100 000	EUR	85 152	83 969	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.125% 22 - 30.06.25	150 000	EUR	158 774	159 295	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.25% 18 - 15.09.25	120 000	EUR	131 771	127 318	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.375% 16 - 09.03.26	120 000	EUR	131 845	126 686	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.375% 18 - 23.04.25	120 000	EUR	132 151	128 287	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.375% 20 - 18.07.25	100 000	USD	93 804	93 880	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.625% 15 - 15.01.25	120 000	EUR	121 422	129 244	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.75% 18 - 28.06.28	100 000	EUR	110 430	102 763	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.75% 20 - 30.09.30	200 000	USD	179 777	162 640	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.75% 21 - 19.02.26	12 000	CAD	9 223	8 496	0,00
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.875% 19 - 04.07.39	50 000	EUR	52 705	41 972	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.125% 17 - 15.06.37	50 000	EUR	54 629	45 096	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.125% 22 - 31.03.37	100 000	EUR	84 151	90 800	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.25% 22 - 31.01.25	300 000	USD	296 073	289 026	0,04
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.25% 22 - 31.07.26	100 000	GBP	115 685	118 920	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.375% 19 - 15.12.25	30 000	GBP	39 266	36 271	0,00
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.375% 22 - 07.06.32	150 000	EUR	132 091	151 749	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.75% 22 - 17.03.25	6 000	CAD	4 750	4 397	0,00
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.00% 15 - 02.05.25	200 000	USD	194 569	193 268	0,03
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.00% 22 - 15.11.29	100 000	EUR	105 004	107 908	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.75% 23 - 15.03.28	150 000	EUR	162 054	168 070	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.875% 23 - 29.05.26	100 000	EUR	107 697	111 400	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.00% 22 - 20.05.27	150 000	USD	149 295	144 963	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.125% 22 - 10.06.25	110 000	USD	108 345	107 812	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.125% 23 - 07.06.30	100 000	EUR	110 361	114 857	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.75% 23 - 15.02.28	50 000	USD	49 828	49 537	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 4.20% 23 - 08.02.29	100 000	AUD	66 526	68 075	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 4.625% 23 - 07.08.26	150 000	USD	150 614	151 695	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5.05% 05 - 04.02.25	10 000	CAD	8 230	7 603	0,00
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5.75% 01 - 07.06.32	30 000	GBP	51 315	43 821	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 6.00% 01 - 07.12.28	40 000	GBP	63 324	56 128	0,01
Land Baden-Wuerttemberg 0.125% 20 - 19.11.40	100 000	EUR	91 365	70 012	0,01
Land Berlin 0.01% 20 - 02.07.30	58 000	EUR	60 135	54 573	0,01
Land Berlin 0.05% 20 - 06.08.40	100 000	EUR	85 900	68 871	0,01
Land Berlin 0.15% 21 - 22.02.36	100 000	EUR	87 477	80 915	0,01
Land Berlin 0.625% 19 - 05.02.29	43 000	EUR	46 800	43 387	0,01
Land Berlin 3.00% 23 - 04.05.28	100 000	EUR	109 823	112 958	0,02
Land Thueringen 0.50% 17 - 02.03.27	100 000	EUR	101 278	103 842	0,01
Landesbank Baden-Wuerttemberg 0.01% 20 - 16.07.27	50 000	EUR	53 400	50 386	0,01
Landesbank Baden-Wuerttemberg 0.375% 21 - 07.05.29	100 000	EUR	101 720	92 485	0,01
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 0.625% 17 - 12.01.27	100 000	EUR	109 443	103 931	0,01
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 4.00% 23 - 04.02.30	100 000	EUR	109 146	114 214	0,02
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 0.375% 22 - 25.02.27	200 000	EUR	199 181	206 879	0,03
Landwirtschaftliche Rentenbank Zero Coupon 21 - 30.06.31	70 000	EUR	71 806	64 154	0,01
Landwirtschaftliche Rentenbank 0.01% 20 - 26.11.40	60 000	EUR	54 169	40 874	0,01
Landwirtschaftliche Rentenbank 0.05% 19 - 18.12.29	120 000	EUR	110 275	115 083	0,02
Landwirtschaftliche Rentenbank 0.50% 18 - 06.03.25	100 000	EUR	98 713	107 345	0,02
Landwirtschaftliche Rentenbank 0.50% 19 - 28.02.29	90 000	EUR	97 720	90 194	0,01
Landwirtschaftliche Rentenbank 0.625% 17 - 18.05.27	80 000	EUR	88 046	83 136	0,01
Landwirtschaftliche Rentenbank 2.00% 15 - 13.01.25	200 000	USD	199 242	194 396	0,03
Landwirtschaftliche Rentenbank 3.20% 18 - 25.05.29	100 000	AUD	63 837	64 662	0,01
LANXESS AG 1.00% 16 - 07.10.26	100 000	EUR	109 159	103 992	0,01
LEG Immobilien SE 0.875% 19 - 28.11.27	100 000	EUR	105 797	99 924	0,01
Mercedes-Benz Group AG 1.125% 19 - 06.11.31	40 000	EUR	42 144	38 665	0,01
Mercedes-Benz Group AG 1.50% 17 - 03.07.29	100 000	EUR	100 853	103 337	0,01
Mercedes-Benz Group AG 2.375% 20 - 22.05.30	40 000	EUR	46 249	42 625	0,01
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	100 000	EUR	110 309	101 387	0,01
Muenchener Hypothekenbank eG 0.125% 20 - 05.09.35	100 000	EUR	96 208	80 820	0,01
Muenchener Hypothekenbank eG 0.50% 15 - 14.03.25	60 000	EUR	65 979	64 129	0,01
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 18 - 26.05.49	100 000	EUR	113 958	106 971	0,02
Niedersachsen Invest GmbH Zero Coupon 20 - 16.07.25	200 000	EUR	209 784	210 997	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Norddeutsche Landesbank-Girozentrale 0.25% 16 - 28.10.26	100 000	EUR	108 280	103 186	0,01
NRW Bank 0.125% 22 - 04.02.30	9 000	EUR	8 497	8 612	0,00
NRW Bank 0.25% 22 - 16.03.27	100 000	EUR	109 156	102 846	0,01
NRW Bank 0.375% 16 - 17.11.26	20 000	EUR	21 788	20 767	0,00
NRW Bank 0.625% 17 - 11.11.27	20 000	EUR	21 885	20 567	0,00
NRW Bank 1.20% 19 - 28.03.39	70 000	EUR	53 503	60 613	0,01
NRW Bank 2.875% 23 - 05.04.33	100 000	EUR	109 105	112 730	0,02
NRW Bank 3.00% 23 - 31.05.30	100 000	EUR	107 029	113 612	0,02
NRW Bank 3.875% 23 - 26.05.26	200 000	USD	196 217	197 746	0,03
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 18 - 05.07.25	100 000	EUR	111 167	107 444	0,02
Robert Bosch GmbH 4.375% 23 - 02.06.43	100 000	EUR	109 350	118 528	0,02
Santander Consumer Bank AG 4.50% 23 - 30.06.26	100 000	EUR	109 173	112 941	0,02
SAP SE 1.625% 18 - 10.03.31	100 000	EUR	111 738	103 050	0,01
State of Brandenburg 0.375% 20 - 29.01.35	100 000	EUR	100 580	86 053	0,01
State of Brandenburg 3.00% 23 - 27.02.32	50 000	EUR	52 212	57 071	0,01
State of Bremen 0.45% 22 - 15.03.29	7 000	EUR	7 616	6 983	0,00
State of Bremen 0.55% 20 - 04.02.50	30 000	EUR	28 176	18 223	0,00
State of Bremen 3.00% 23 - 02.03.33	100 000	EUR	108 238	114 233	0,02
State of Hesse Zero Coupon 21 - 10.06.26	100 000	EUR	92 893	103 860	0,01
State of Hesse 0.01% 20 - 11.03.30	60 000	EUR	62 436	57 079	0,01
State of Hesse 1.30% 18 - 10.10.33	50 000	EUR	56 041	49 118	0,01
State of Lower Saxony 0.125% 19 - 08.04.27	82 000	EUR	88 517	83 965	0,01
State of Lower Saxony 0.25% 22 - 09.04.29	100 000	EUR	101 024	98 519	0,01
State of Lower Saxony 0.75% 22 - 21.03.31	100 000	EUR	97 567	97 664	0,01
State of Lower Saxony 2.75% 23 - 17.02.31	100 000	EUR	107 295	112 204	0,02
State of North Rhine-Westphalia Germany Zero Coupon 20 - 05.05.25	99 000	EUR	108 725	105 133	0,02
State of North Rhine-Westphalia Germany 0.125% 21 - 04.06.31	100 000	EUR	103 398	92 871	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 0.20% 20 - 09.04.30	39 000	EUR	36 946	37 473	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 0.20% 21 - 27.01.51	58 000	EUR	49 013	30 723	0,00
State of North Rhine-Westphalia Germany 0.25% 19 - 13.03.26	150 000	EUR	152 712	157 365	0,02
State of North Rhine-Westphalia Germany 0.50% 19 - 25.11.39	58 000	EUR	56 608	44 481	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 0.75% 16 - 16.08.41	48 000	EUR	48 311	36 854	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 0.95% 18 - 13.03.28	81 000	EUR	89 723	84 174	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 1.00% 16 - 16.10.46	40 000	EUR	41 918	29 791	0,00
State of North Rhine-Westphalia Germany 1.25% 16 - 12.05.36	116 000	EUR	127 481	108 060	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
State of North Rhine-Westphalia Germany 1.45% 22 - 19.01.22	100 000	EUR	92 491	58 303	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 1.55% 17 - 16.06.48	60 000	EUR	70 722	49 738	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 1.75% 17 - 26.10.57	50 000	EUR	60 384	40 079	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 1.95% 18 - 26.09.78	60 000	EUR	75 638	47 422	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 2.25% 22 - 14.06.52	80 000	EUR	73 077	75 294	0,01
State of North Rhine-Westphalia Germany 2.90% 23 - 15.01.53	100 000	EUR	109 431	107 245	0,02
State of North Rhine-Westphalia Germany 3.15% 23 - 20.11.26	100 000	EUR	109 521	112 332	0,02
State of Rhineland-Palatinate 0.75% 16 - 19.01.26	50 000	EUR	55 193	53 123	0,01
State of Rhineland-Palatinate 0.75% 22 - 23.02.32	100 000	EUR	100 556	96 085	0,01
State of Rhineland-Palatinate 3.50% 23 - 16.06.25	100 000	EUR	109 349	111 343	0,02
State of Saxony-Anhalt Zero Coupon 21 - 10.03.31	100 000	EUR	102 697	92 437	0,01
State of Saxony-Anhalt 2.95% 23 - 20.06.33	100 000	EUR	108 498	113 850	0,02
State of Schleswig-Holstein Germany 0.01% 20 - 26.11.29	100 000	EUR	98 692	95 776	0,01
State of Schleswig-Holstein Germany 0.01% 21 - 29.10.26	57 000	EUR	57 032	58 678	0,01
State of Schleswig-Holstein Germany 3.00% 23 - 05.06.30	100 000	EUR	107 117	113 863	0,02
UniCredit Bank AG 0.01% 21 - 10.03.31	30 000	EUR	30 527	27 401	0,00
UniCredit Bank AG 0.50% 17 - 04.05.26	80 000	EUR	87 545	83 755	0,01
UniCredit Bank AG 0.85% 19 - 22.05.34	50 000	EUR	52 772	45 483	0,01
UniCredit Bank AG 2.625% 22 - 27.04.28	200 000	EUR	214 503	220 680	0,03
Vier Gas Transport GmbH 2.875% 13 - 12.06.25	100 000	EUR	113 472	110 009	0,02
Vonovia SE 1.00% 21 - 16.06.33	100 000	EUR	98 997	83 886	0,01
Vonovia SE 1.50% 21 - 14.06.41	100 000	EUR	89 274	71 835	0,01
Vonovia SE 4.75% 22 - 23.05.27	100 000	EUR	108 153	114 551	0,02
			35 861 722	34 803 692	5,09
Hong Kong					
AIA Group Ltd. 144A 3.20% 20 - 16.09.40	50 000	USD	44 906	37 849	0,01
Airport Authority 144A 1.75% 22 - 12.01.27	200 000	USD	194 133	185 338	0,03
Hong Kong 1.59% 21 - 04.03.36	50 000	HKD	5 418	5 258	0,00
Hong Kong 1.68% 16 - 21.01.26	250 000	HKD	31 778	30 891	0,00
Hong Kong 1.79% 22 - 14.04.25	100 000	HKD	12 551	12 483	0,00
Hong Kong 1.89% 17 - 02.03.32	100 000	HKD	11 808	11 635	0,00
Hong Kong 1.97% 19 - 17.01.29	100 000	HKD	12 737	12 145	0,00
Hong Kong 2.13% 15 - 16.07.30	50 000	HKD	5 857	6 039	0,00
Hong Kong 3.375% 23 - 07.06.27	100 000	EUR	108 957	112 250	0,02
Lenovo Group Ltd. 5.831% 22 - 27.01.28	50 000	USD	51 106	51 028	0,01
			479 251	464 916	0,07
Hongrie					
Hungary 1.50% 21 - 26.08.26	35 000 000	HUF	90 670	90 223	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Hongrie (suite)					
Hungary 1.625% 20 - 28.04.32	40 000	EUR	33 575	35 913	0,00
Hungary 1.75% 20 - 05.06.35	60 000	EUR	62 506	50 809	0,01
Hungary 2.00% 20 - 23.05.29	25 000 000	HUF	59 211	60 286	0,01
Hungary 2.25% 20 - 20.04.33	20 000 000	HUF	42 463	43 687	0,01
Hungary 3.00% 18 - 27.10.38	25 000 000	HUF	50 432	50 563	0,01
Hungary 3.00% 19 - 21.08.30	25 000 000	HUF	54 001	61 869	0,01
Hungary 3.125% 21 - 21.09.51	200 000	USD	168 863	135 202	0,02
Hungary 3.25% 15 - 22.10.31	35 000 000	HUF	83 657	85 992	0,01
Hungary 4.75% 22 - 24.11.32	25 000 000	HUF	55 450	66 595	0,01
Hungary 5.25% 22 - 16.06.29	300 000	USD	298 664	302 217	0,04
Hungary 5.50% 14 - 24.06.25	45 000 000	HUF	130 516	128 556	0,02
Hungary 6.75% 11 - 22.10.28	20 000 000	HUF	59 183	60 030	0,01
			1 189 191	1 171 942	0,17
Inde					
ICICI Bank Ltd. 4.00% 16 - 18.03.26	50 000	USD	50 336	48 908	0,01
			50 336	48 908	0,01
Indonésie					
Indonesia Zero Coupon 21 - 15.06.42	2 006 000 000	IDR	136 920	135 087	0,02
Indonesia 1.00% 21 - 28.07.29	100 000	EUR	92 822	96 123	0,01
Indonesia 1.75% 18 - 24.04.25	100 000	EUR	106 325	107 190	0,02
Indonesia 3.05% 21 - 12.03.51	100 000	USD	69 777	76 334	0,01
Indonesia 4.55% 23 - 11.01.28	100 000	USD	99 703	99 938	0,01
Indonesia 4.625% 13 - 15.04.43	100 000	USD	97 244	98 109	0,01
Indonesia 5.125% 21 - 15.04.27	1 569 000 000	IDR	101 479	98 323	0,01
Indonesia 5.25% 12 - 17.01.42	105 000	USD	106 519	109 156	0,02
Indonesia 5.25% 16 - 08.01.47	160 000	USD	158 197	167 299	0,02
Indonesia 5.50% 20 - 15.04.26	2 472 000 000	IDR	160 529	157 646	0,02
Indonesia 5.95% 15 - 08.01.46	200 000	USD	214 836	225 086	0,03
Indonesia 6.125% 12 - 15.05.28	1 582 000 000	IDR	104 486	101 486	0,02
Indonesia 6.25% 21 - 15.06.36	1 500 000 000	IDR	96 333	94 627	0,01
Indonesia 6.375% 12 - 15.04.42	1 000 000 000	IDR	64 228	63 542	0,01
Indonesia 6.375% 21 - 15.04.32	2 491 000 000	IDR	163 498	160 097	0,02
Indonesia 6.375% 22 - 15.08.28	1 200 000 000	IDR	80 348	77 742	0,01
Indonesia 6.50% 19 - 15.06.25	2 057 000 000	IDR	137 920	133 640	0,02
Indonesia 6.50% 20 - 15.02.31	2 531 000 000	IDR	167 778	164 010	0,02
Indonesia 6.625% 12 - 15.05.33	1 473 000 000	IDR	97 765	96 090	0,01
Indonesia 6.875% 21 - 15.08.51	679 000 000	IDR	44 169	44 091	0,01
Indonesia 7.00% 11 - 15.05.27	1 617 000 000	IDR	110 122	106 806	0,02
Indonesia 7.00% 19 - 15.09.30	3 100 000 000	IDR	210 973	206 065	0,03
Indonesia 7.00% 22 - 15.02.33	2 819 000 000	IDR	191 081	189 587	0,03
Indonesia 7.125% 22 - 15.06.43	975 000 000	IDR	68 165	65 695	0,01
Indonesia 7.125% 22 - 15.06.38	1 000 000 000	IDR	67 530	67 976	0,01
Indonesia 7.25% 20 - 15.02.26	521 000 000	IDR	35 501	34 287	0,01
Indonesia 7.375% 17 - 15.05.48	952 000 000	IDR	65 004	65 185	0,01
Indonesia 7.50% 16 - 15.08.32	703 000 000	IDR	49 178	48 343	0,01
Indonesia 7.50% 17 - 15.05.38	1 500 000 000	IDR	104 933	104 275	0,02
Indonesia 7.50% 19 - 15.06.35	2 410 000 000	IDR	165 755	167 318	0,02
Indonesia 7.50% 19 - 15.04.40	1 985 000 000	IDR	138 310	137 745	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 8.25% 11 - 15.06.32	592 000 000	IDR	42 613	42 224	0,01
Indonesia 8.25% 15 - 15.05.36	1 258 000 000	IDR	92 949	92 196	0,01
Indonesia 8.25% 18 - 15.05.29	2 405 000 000	IDR	170 427	168 345	0,02
Indonesia 8.375% 10 - 15.09.26	1 680 000 000	IDR	117 792	114 449	0,02
Indonesia 8.375% 13 - 15.03.34	1 906 000 000	IDR	140 608	139 850	0,02
Indonesia 8.375% 19 - 15.04.39	700 000 000	IDR	52 668	52 296	0,01
Indonesia 8.75% 13 - 15.02.44	1 294 000 000	IDR	99 381	101 355	0,02
Indonesia 8.75% 15 - 15.05.31	923 000 000	IDR	68 704	67 240	0,01
Indonesia 9.00% 13 - 15.03.29	1 292 000 000	IDR	95 344	92 988	0,01
Indonesia 10.00% 07 - 15.02.28	800 000 000	IDR	59 305	58 121	0,01
Indonesia 10.25% 07 - 15.07.27	659 000 000	IDR	48 101	47 757	0,01
Indonesia 10.50% 09 - 15.08.30	800 000 000	IDR	65 321	62 263	0,01
Indonesia 11.00% 06 - 15.09.25	600 000 000	IDR	41 806	41 820	0,01
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 6.10% 12 - 15.02.37	1 000 000 000	IDR	61 547	60 523	0,01
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 6.125% 18 - 15.10.25	873 000 000	IDR	58 445	56 068	0,01
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 6.375% 21 - 15.03.34	1 023 000 000	IDR	65 397	63 910	0,01
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 6.75% 22 - 15.06.47	1 500 000 000	IDR	95 277	95 630	0,01
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 8.875% 16 - 15.11.31	1 500 000 000	IDR	111 162	110 181	0,02
			4 994 275	4 966 114	0,73
Irlande					
AerCap Ireland Capital Dac / AerCap Global Aviation Trust 2.45% 21 - 29.10.26	90 000	USD	85 946	83 373	0,01
AerCap Ireland Capital Dac / AerCap Global Aviation Trust 3.00% 21 - 29.10.28	70 000	USD	65 835	63 844	0,01
AerCap Ireland Capital Dac / AerCap Global Aviation Trust 3.30% 21 - 30.01.32	130 000	USD	119 690	113 327	0,02
AerCap Ireland Capital Dac / AerCap Global Aviation Trust 3.85% 21 - 29.10.41	15 000	USD	13 262	12 161	0,00
AerCap Ireland Capital Dac / AerCap Global Aviation Trust 3.875% 18 - 23.01.28	40 000	USD	39 157	38 161	0,01
AerCap Ireland Capital Dac / AerCap Global Aviation Trust 6.50% 20 - 15.07.25	35 000	USD	35 927	35 469	0,01
CA Auto Bank SpA 4.75% 23 - 25.01.27	100 000	EUR	106 683	114 131	0,02
DXC Capital Funding Dac 0.45% 21 - 15.09.27	100 000	EUR	103 707	98 058	0,01
Fresenius Finance Ireland PLC 0.50% 21 - 01.10.28	100 000	EUR	103 800	97 880	0,01
Ireland Zero Coupon 21 - 18.10.31	90 000	EUR	87 376	83 425	0,01
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	90 000	EUR	89 861	93 164	0,01
Ireland 0.20% 20 - 18.10.30	80 000	EUR	75 285	77 031	0,01
Ireland 0.35% 22 - 18.10.32	39 000	EUR	40 269	36 319	0,01
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	59 000	EUR	59 466	51 759	0,01
Ireland 0.55% 21 - 22.04.41	45 000	EUR	43 590	34 834	0,01
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	92 000	EUR	102 488	96 529	0,01
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	180 000	EUR	191 107	193 105	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	111 000	EUR	124 578	116 056	0,02
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	56 000	EUR	62 593	56 266	0,01
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	100 000	EUR	92 380	103 907	0,02
Ireland 1.50% 19 - 15.05.50	117 000	EUR	104 909	97 499	0,01
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	67 000	EUR	71 107	66 037	0,01
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	145 000	EUR	154 033	138 612	0,02
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	140 000	EUR	156 753	156 290	0,02
Ireland 3.00% 23 - 18.10.43	37 000	EUR	40 082	42 418	0,01
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	125 000	EUR	146 610	141 982	0,02
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 0.375% 20 - 15.09.27	100 000	EUR	105 360	99 712	0,02
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 2.00% 21 - 16.09.31	35 000	USD	31 468	29 132	0,00
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 0.625% 19 - 20.09.29	100 000	EUR	92 336	97 362	0,01
Shire Acquisitions Investments Ireland Dac 3.20% 16 - 23.09.26	75 000	USD	74 968	72 190	0,01
Smurfit Kappa Treasury ULC 0.50% 21 - 22.09.29	100 000	EUR	101 850	94 479	0,01
STERIS Irish FinCo UnLtd Co. 3.75% 21 - 15.03.51	30 000	USD	27 664	23 322	0,00
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. FRN 20 - 17.09.50	100 000	EUR	103 351	96 145	0,01
			2 853 491	2 753 979	0,40
Israël					
Israel 0.50% 20 - 30.04.25	300 000	ILS	92 033	79 726	0,01
Israel 0.50% 21 - 27.02.26	400 000	ILS	111 915	103 720	0,02
Israel 0.625% 22 - 18.01.32	60 000	EUR	61 930	51 153	0,01
Israel 1.00% 19 - 31.03.30	400 000	ILS	113 653	94 046	0,01
Israel 1.30% 21 - 30.04.32	200 000	ILS	52 905	45 228	0,01
Israel 1.50% 17 - 18.01.27	100 000	EUR	111 855	102 397	0,02
Israel 1.50% 20 - 31.05.37	550 000	ILS	123 479	109 584	0,02
Israel 1.75% 15 - 31.08.25	200 000	ILS	54 752	53 717	0,01
Israel 2.00% 16 - 31.03.27	300 000	ILS	93 484	79 160	0,01
Israel 2.25% 18 - 28.09.28	300 000	ILS	91 493	78 259	0,01
Israel 2.50% 20 - 15.01.30	250 000	USD	246 828	217 870	0,03
Israel 2.80% 22 - 29.11.52	160 000	ILS	33 647	31 729	0,00
Israel 3.75% 17 - 31.03.47	438 000	ILS	136 060	107 697	0,02
Israel 3.75% 23 - 28.02.29	200 000	ILS	53 163	57 086	0,01
Israel 3.80% 20 - 13.05.60	350 000	USD	347 810	250 506	0,04
Israel 4.50% 23 - 17.01.33	100 000	USD	100 533	95 029	0,01
Israel 5.50% 12 - 31.01.42	311 000	ILS	132 079	98 029	0,01
Israel 6.25% 06 - 30.10.26	100 000	ILS	29 461	29 690	0,00
			1 987 080	1 684 626	0,25
Italie					
ASTM SpA 2.375% 21 - 25.11.33	100 000	EUR	102 773	92 685	0,01
Banco BPM SpA 4.625% 23 - 29.11.27	100 000	EUR	110 206	113 870	0,02
BPER Banca 3.75% 23 - 22.10.28	100 000	EUR	109 593	113 303	0,02
Genertel SpA FRN 17 - 14.12.47	100 000	EUR	113 274	109 630	0,02
Iccrea Banca SpA 4.00% 23 - 08.11.27	100 000	EUR	110 264	113 533	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.75% 18 - 20.03.28	100 000	EUR	109 196	103 149	0,01
Intesa Sanpaolo SpA 3.25% 14 - 10.02.26	100 000	EUR	107 692	110 810	0,02
Intesa Sanpaolo SpA FRN 23 - 08.03.28	150 000	EUR	160 904	171 421	0,02
Italgas SpA 0.875% 19 - 24.04.30	100 000	EUR	103 527	95 044	0,01
Italy Zero Coupon 21 - 01.04.26	200 000	EUR	199 996	207 475	0,03
Italy Zero Coupon 21 - 01.08.26	250 000	EUR	267 690	257 254	0,04
Italy 0.25% 21 - 15.03.28	150 000	EUR	137 060	148 548	0,02
Italy 0.35% 19 - 01.02.25	225 000	EUR	246 968	241 043	0,04
Italy 0.45% 21 - 15.02.29	100 000	EUR	96 691	97 093	0,01
Italy 0.50% 20 - 01.02.26	100 000	EUR	98 128	105 271	0,02
Italy 0.50% 21 - 15.07.28	180 000	EUR	169 914	178 528	0,03
Italy 0.85% 19 - 15.01.27	204 000	EUR	222 696	212 815	0,03
Italy 0.90% 20 - 01.04.31	300 000	EUR	253 656	280 267	0,04
Italy 0.95% 20 - 01.08.30	300 000	EUR	275 863	286 541	0,04
Italy 0.95% 20 - 15.09.27	240 000	EUR	234 272	247 796	0,04
Italy 0.95% 21 - 01.06.32	270 000	EUR	232 120	244 265	0,04
Italy 1.10% 22 - 01.04.27	140 000	EUR	143 880	146 608	0,02
Italy 1.20% 22 - 15.08.25	200 000	EUR	210 103	214 815	0,03
Italy 1.25% 16 - 01.12.26	219 000	EUR	242 311	231 780	0,03
Italy 1.35% 19 - 01.04.30	253 000	EUR	272 231	250 556	0,04
Italy 1.45% 18 - 15.05.25	200 000	EUR	211 598	216 286	0,03
Italy 1.50% 15 - 01.06.25	370 000	EUR	402 029	400 088	0,06
Italy 1.60% 16 - 01.06.26	280 000	EUR	312 924	300 895	0,04
Italy 2.00% 15 - 01.12.25	300 000	EUR	337 832	326 189	0,05
Italy 2.00% 18 - 01.02.28	300 000	EUR	339 134	320 416	0,05
Italy 2.05% 17 - 01.08.27	300 000	EUR	328 711	322 825	0,05
Italy 2.10% 19 - 15.07.26	190 000	EUR	199 508	206 450	0,03
Italy 2.20% 17 - 01.06.27	200 000	EUR	197 526	216 686	0,03
Italy 2.50% 18 - 15.11.25	250 000	EUR	284 074	274 431	0,04
Italy 2.50% 22 - 01.12.32	200 000	EUR	198 905	203 998	0,03
Italy 2.65% 22 - 01.12.27	191 000	EUR	194 826	209 361	0,03
Italy 2.80% 18 - 01.12.28	340 000	EUR	398 074	372 809	0,05
Italy 2.80% 22 - 15.06.29	200 000	EUR	200 378	217 740	0,03
Italy 3.00% 19 - 01.08.29	232 000	EUR	274 564	255 313	0,04
Italy 3.40% 22 - 01.04.28	210 000	EUR	225 143	236 326	0,03
Italy 3.40% 23 - 28.03.25	100 000	EUR	105 656	110 765	0,02
Italy 3.50% 22 - 15.01.26	150 000	EUR	159 568	167 840	0,02
Italy 3.60% 23 - 29.09.25	100 000	EUR	110 256	111 624	0,02
Italy 3.70% 23 - 15.06.30	232 000	EUR	252 546	262 934	0,04
Italy 3.80% 23 - 15.04.26	200 000	EUR	218 928	225 748	0,03
Italy 3.80% 23 - 01.08.28	220 000	EUR	241 899	251 400	0,04
Italy 3.85% 22 - 15.12.29	300 000	EUR	333 286	343 428	0,05
Italy 3.85% 23 - 15.09.26	120 000	EUR	133 299	136 116	0,02
Italy 3.875% 21 - 06.05.51	250 000	USD	230 660	179 582	0,03
Italy 4.00% 19 - 17.10.49	100 000	USD	78 128	75 203	0,01
Italy 4.00% 23 - 15.11.30	80 000	EUR	82 939	92 153	0,01
Italy 4.10% 23 - 01.02.29	134 000	EUR	141 697	155 245	0,02
Italy 4.20% 23 - 01.03.34	100 000	EUR	101 335	115 377	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.35% 23 - 01.11.33	220 000	EUR	245 071	257 378	0,04
Italy 4.40% 22 - 01.05.33	220 000	EUR	238 630	258 992	0,04
Italy 5.20% 04 - 31.07.34	100 000	EUR	104 341	121 715	0,02
Italy 5.25% 98 - 01.11.29	388 000	EUR	504 714	477 461	0,07
Italy 5.75% 02 - 01.02.33	280 000	EUR	404 151	361 228	0,05
Italy 6.00% 98 - 04.08.28	60 000	GBP	89 440	80 298	0,01
Italy 6.00% 00 - 01.05.31	320 000	EUR	438 490	415 737	0,06
Italy 6.50% 97 - 01.11.27	400 000	EUR	516 934	499 832	0,07
Italy 7.25% 97 - 01.11.26	150 000	EUR	180 889	185 674	0,03
Italy 144A 0.60% 21 - 01.08.31	220 000	EUR	185 701	198 601	0,03
Italy 144A 0.95% 21 - 01.03.37	200 000	EUR	146 608	154 828	0,02
Italy 144A 0.95% 21 - 01.12.31	180 000	EUR	174 568	165 373	0,02
Italy 144A 1.45% 20 - 01.03.36	157 000	EUR	160 027	133 480	0,02
Italy 144A 1.50% 21 - 30.04.45	170 000	EUR	116 421	118 781	0,02
Italy 144A 1.65% 15 - 01.03.32	280 000	EUR	301 481	270 494	0,04
Italy 144A 1.65% 20 - 01.12.30	300 000	EUR	325 782	297 904	0,04
Italy 144A 1.70% 20 - 01.09.51	207 000	EUR	170 642	140 367	0,02
Italy 144A 1.80% 20 - 01.03.41	238 000	EUR	226 052	189 611	0,03
Italy 144A 1.85% 20 - 01.07.25	186 000	EUR	178 761	201 974	0,03
Italy 144A 2.15% 21 - 01.03.72	54 000	EUR	50 315	36 408	0,01
Italy 144A 2.15% 22 - 01.09.52	117 000	EUR	108 727	86 016	0,01
Italy 144A 2.25% 16 - 01.09.36	167 000	EUR	185 350	154 649	0,02
Italy 144A 2.45% 17 - 01.09.33	304 000	EUR	327 731	304 852	0,04
Italy 144A 2.45% 20 - 01.09.50	178 000	EUR	170 612	143 796	0,02
Italy 144A 2.70% 16 - 01.03.47	220 000	EUR	221 047	191 560	0,03
Italy 144A 2.80% 16 - 01.03.67	115 000	EUR	112 342	93 038	0,01
Italy 144A 2.95% 18 - 01.09.38	159 000	EUR	189 698	155 702	0,02
Italy 144A 3.10% 19 - 01.03.40	145 000	EUR	175 930	141 873	0,02
Italy 144A 3.25% 15 - 01.09.46	180 000	EUR	206 413	172 302	0,03
Italy 144A 3.25% 22 - 01.03.38	120 000	EUR	110 143	121 737	0,02
Italy 144A 3.35% 19 - 01.03.35	161 000	EUR	198 198	171 044	0,02
Italy 144A 3.45% 17 - 01.03.48	235 000	EUR	255 295	231 920	0,03
Italy 144A 3.50% 14 - 01.03.30	328 000	EUR	381 968	369 144	0,05
Italy 144A 3.85% 19 - 01.09.49	179 000	EUR	202 813	186 808	0,03
Italy 144A 4.00% 05 - 01.02.37	420 000	EUR	501 702	469 683	0,07
Italy 144A 4.00% 22 - 30.04.35	110 000	EUR	105 333	124 107	0,02
Italy 144A 4.00% 23 - 30.10.31	140 000	EUR	154 698	161 165	0,02
Italy 144A 4.45% 23 - 01.09.43	275 000	EUR	314 576	313 330	0,05
Italy 144A 4.50% 10 - 01.03.26	320 000	EUR	380 266	365 765	0,05
Italy 144A 4.50% 23 - 01.10.53	100 000	EUR	106 067	113 624	0,02
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.28	300 000	EUR	379 706	356 932	0,05
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.44	240 000	EUR	336 307	285 159	0,04
Italy 144A 5.00% 03 - 01.08.34	370 000	EUR	482 798	455 069	0,07
Italy 144A 5.00% 07 - 01.08.39	238 000	EUR	297 502	290 378	0,04
Italy 144A 5.00% 09 - 01.03.25	300 000	EUR	347 931	338 162	0,05
Italy 144A 5.00% 09 - 01.09.40	241 000	EUR	362 292	294 139	0,04
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.375% 15 - 10.11.25	150 000	EUR	155 959	160 481	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.625% 19 - 07.01.25	100 000	EUR	110 686	107 934	0,02
Snam SpA 0.75% 20 - 17.06.30	100 000	EUR	88 618	93 786	0,01
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.375% 17 - 26.07.27	100 000	EUR	110 084	104 107	0,02
UniCredit SpA 0.85% 21 - 19.01.31	100 000	EUR	98 207	91 074	0,01
UniCredit SpA FRN 20 - 16.06.26	100 000	EUR	102 703	106 624	0,02
			22 667 151	22 003 424	3,21
Japon					
Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd. 144A FRN 16 - 29.12.49	70 000	USD	69 913	67 133	0,01
Development Bank of Japan Inc. 144A 1.75% 21 - 20.10.31	180 000	USD	168 798	149 674	0,02
East Japan Railway Co. 4.11% 23 - 22.02.43	100 000	EUR	115 429	116 684	0,02
East Nippon Expressway Co. Ltd. 0.225% 20 - 24.04.30	40 000 000	JPY	292 083	278 618	0,04
Honda Motor Co. Ltd. 2.534% 22 - 10.03.27	110 000	USD	104 774	103 728	0,01
Honda Motor Co. Ltd. 2.967% 22 - 10.03.32	50 000	USD	43 989	45 767	0,01
Japan 0.005% 21 - 20.03.26	87 600 000	JPY	717 435	621 060	0,09
Japan 0.005% 21 - 20.06.26	105 000 000	JPY	785 056	744 317	0,11
Japan 0.005% 21 - 20.09.26	105 000 000	JPY	838 654	744 027	0,11
Japan 0.005% 22 - 20.12.26	100 000 000	JPY	727 921	708 136	0,10
Japan 0.005% 22 - 20.03.27	56 600 000	JPY	441 298	400 648	0,06
Japan 0.005% 22 - 20.06.27	110 000 000	JPY	769 981	777 912	0,11
Japan 0.005% 23 - 01.01.25	35 000 000	JPY	269 286	248 389	0,04
Japan 0.005% 23 - 01.02.25	36 000 000	JPY	271 589	255 503	0,04
Japan 0.005% 23 - 01.03.25	37 000 000	JPY	282 942	262 559	0,04
Japan 0.005% 23 - 01.04.25	35 700 000	JPY	272 924	253 412	0,04
Japan 0.005% 23 - 01.05.25	30 000 000	JPY	219 955	212 981	0,03
Japan 0.005% 23 - 01.06.25	18 000 000	JPY	126 108	127 727	0,02
Japan 0.005% 23 - 01.07.25	40 000 000	JPY	278 368	283 805	0,04
Japan 0.005% 23 - 01.08.25	30 000 000	JPY	208 761	212 873	0,03
Japan 0.10% 16 - 20.03.26	91 250 000	JPY	720 782	648 401	0,09
Japan 0.10% 16 - 20.06.26	75 450 000	JPY	599 529	536 172	0,08
Japan 0.10% 16 - 20.09.26	99 500 000	JPY	816 790	706 945	0,10
Japan 0.10% 16 - 20.12.26	110 850 000	JPY	863 319	787 469	0,11
Japan 0.10% 17 - 20.03.27	105 000 000	JPY	845 541	745 546	0,11
Japan 0.10% 17 - 20.06.27	95 000 000	JPY	779 503	674 245	0,10
Japan 0.10% 17 - 20.09.27	105 000 000	JPY	820 168	744 571	0,11
Japan 0.10% 17 - 20.12.27	95 900 000	JPY	765 571	679 796	0,10
Japan 0.10% 18 - 20.03.28	145 000 000	JPY	1 158 418	1 026 787	0,15
Japan 0.10% 18 - 20.06.28	84 500 000	JPY	692 843	597 572	0,09
Japan 0.10% 18 - 20.09.28	100 000 000	JPY	737 226	705 625	0,10
Japan 0.10% 19 - 20.12.28	87 300 000	JPY	687 007	615 534	0,09
Japan 0.10% 19 - 20.03.29	83 800 000	JPY	622 972	590 303	0,09
Japan 0.10% 19 - 20.06.29	73 200 000	JPY	599 131	515 401	0,07
Japan 0.10% 19 - 20.09.29	85 600 000	JPY	657 137	602 127	0,09
Japan 0.10% 20 - 20.12.29	85 000 000	JPY	694 799	597 321	0,09
Japan 0.10% 20 - 20.03.30	70 000 000	JPY	551 582	491 852	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.10% 20 - 20.03.25	80 000 000	JPY	631 083	568 330	0,08
Japan 0.10% 20 - 20.06.30	90 000 000	JPY	718 170	631 238	0,09
Japan 0.10% 20 - 20.06.25	124 950 000	JPY	977 201	887 865	0,13
Japan 0.10% 20 - 20.09.30	109 250 000	JPY	827 238	763 223	0,11
Japan 0.10% 20 - 20.09.25	87 700 000	JPY	719 830	623 088	0,09
Japan 0.10% 21 - 20.12.30	92 150 000	JPY	750 844	642 050	0,09
Japan 0.10% 21 - 20.12.25	110 250 000	JPY	799 152	783 347	0,11
Japan 0.10% 21 - 20.03.31	87 900 000	JPY	662 515	610 699	0,09
Japan 0.10% 21 - 20.06.31	105 000 000	JPY	835 319	727 396	0,11
Japan 0.10% 21 - 20.09.31	95 000 000	JPY	760 774	656 233	0,10
Japan 0.10% 22 - 20.12.31	94 800 000	JPY	708 775	652 962	0,10
Japan 0.10% 22 - 20.03.27	40 000 000	JPY	282 653	284 018	0,04
Japan 0.10% 22 - 20.09.27	85 000 000	JPY	614 707	602 886	0,09
Japan 0.10% 23 - 20.03.28	70 500 000	JPY	492 968	498 776	0,07
Japan 0.10% 23 - 20.06.28	20 000 000	JPY	138 743	141 375	0,02
Japan 0.20% 16 - 20.06.36	36 400 000	JPY	260 522	237 783	0,03
Japan 0.20% 22 - 20.03.32	95 000 000	JPY	686 693	658 881	0,10
Japan 0.20% 22 - 20.06.32	92 300 000	JPY	668 715	637 726	0,09
Japan 0.20% 22 - 20.09.32	101 000 000	JPY	735 697	697 006	0,10
Japan 0.20% 23 - 20.12.27	66 500 000	JPY	499 411	472 901	0,07
Japan 0.20% 23 - 20.03.28	34 000 000	JPY	250 752	241 555	0,03
Japan 0.20% 23 - 20.06.28	31 700 000	JPY	217 547	225 043	0,03
Japan 0.30% 15 - 20.12.25	81 150 000	JPY	646 928	578 843	0,08
Japan 0.30% 16 - 20.06.46	34 000 000	JPY	249 653	186 740	0,03
Japan 0.30% 19 - 20.06.39	32 900 000	JPY	228 193	206 284	0,03
Japan 0.30% 19 - 20.09.39	36 800 000	JPY	253 502	229 573	0,03
Japan 0.30% 20 - 20.12.39	30 000 000	JPY	193 203	186 273	0,03
Japan 0.30% 23 - 20.12.27	30 350 000	JPY	234 455	216 695	0,03
Japan 0.30% 23 - 20.06.28	41 950 000	JPY	275 421	299 095	0,04
Japan 0.30% 23 - 20.09.28	50 900 000	JPY	363 122	362 463	0,05
Japan 0.40% 15 - 20.03.25	93 300 000	JPY	768 922	665 330	0,10
Japan 0.40% 15 - 20.06.25	100 000 000	JPY	825 489	713 697	0,10
Japan 0.40% 15 - 20.09.25	110 000 000	JPY	908 084	785 597	0,11
Japan 0.40% 16 - 20.03.36	45 000 000	JPY	366 175	303 713	0,04
Japan 0.40% 16 - 20.03.56	52 000 000	JPY	345 137	252 217	0,04
Japan 0.40% 19 - 20.03.39	38 500 000	JPY	306 119	246 334	0,04
Japan 0.40% 19 - 20.06.49	29 750 000	JPY	198 217	158 761	0,02
Japan 0.40% 19 - 20.09.49	26 450 000	JPY	176 208	140 584	0,02
Japan 0.40% 20 - 20.12.49	28 800 000	JPY	176 697	153 048	0,02
Japan 0.40% 20 - 20.03.50	23 500 000	JPY	170 354	124 051	0,02
Japan 0.40% 20 - 20.03.40	32 200 000	JPY	253 829	202 188	0,03
Japan 0.40% 20 - 20.06.40	57 000 000	JPY	421 808	356 167	0,05
Japan 0.40% 20 - 20.09.40	43 200 000	JPY	266 348	268 561	0,04
Japan 0.40% 21 - 20.06.41	40 000 000	JPY	312 004	245 050	0,04
Japan 0.40% 23 - 20.06.33	104 850 000	JPY	724 369	730 164	0,11
Japan 0.40% 23 - 20.09.28	32 850 000	JPY	223 706	235 011	0,03
Japan 0.50% 16 - 20.09.36	50 000 000	JPY	410 720	339 272	0,05
Japan 0.50% 16 - 20.09.46	35 850 000	JPY	216 720	205 554	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.50% 18 - 20.03.38	61 350 000	JPY	491 831	405 333	0,06
Japan 0.50% 18 - 20.06.38	35 600 000	JPY	289 070	234 317	0,03
Japan 0.50% 19 - 20.12.38	40 000 000	JPY	287 277	261 050	0,04
Japan 0.50% 19 - 20.03.49	30 000 000	JPY	175 356	165 204	0,02
Japan 0.50% 19 - 20.03.59	32 800 000	JPY	194 269	159 193	0,02
Japan 0.50% 20 - 20.03.60	52 400 000	JPY	342 101	251 749	0,04
Japan 0.50% 21 - 20.12.40	46 150 000	JPY	310 222	290 528	0,04
Japan 0.50% 21 - 20.03.41	45 900 000	JPY	364 926	287 420	0,04
Japan 0.50% 21 - 20.09.41	42 000 000	JPY	332 816	260 949	0,04
Japan 0.50% 22 - 20.12.41	55 000 000	JPY	390 946	340 202	0,05
Japan 0.50% 23 - 20.12.32	88 000 000	JPY	661 186	621 299	0,09
Japan 0.50% 23 - 20.03.33	106 600 000	JPY	755 179	750 865	0,11
Japan 0.60% 16 - 20.12.36	51 000 000	JPY	394 788	348 083	0,05
Japan 0.60% 16 - 20.12.46	30 000 000	JPY	228 472	175 512	0,03
Japan 0.60% 17 - 20.06.37	42 000 000	JPY	314 448	285 143	0,04
Japan 0.60% 17 - 20.09.37	40 000 000	JPY	311 770	269 996	0,04
Japan 0.60% 17 - 20.12.37	45 000 000	JPY	357 067	302 998	0,04
Japan 0.60% 20 - 20.06.50	31 350 000	JPY	238 531	174 157	0,03
Japan 0.60% 20 - 20.09.50	33 400 000	JPY	211 457	184 998	0,03
Japan 0.70% 17 - 20.03.37	57 000 000	JPY	423 830	392 685	0,06
Japan 0.70% 18 - 20.06.48	28 750 000	JPY	227 404	168 784	0,02
Japan 0.70% 18 - 20.09.38	45 000 000	JPY	331 610	303 694	0,04
Japan 0.70% 19 - 20.12.48	32 900 000	JPY	228 245	191 552	0,03
Japan 0.70% 21 - 20.12.50	30 900 000	JPY	241 106	175 484	0,03
Japan 0.70% 21 - 20.03.51	31 650 000	JPY	246 490	179 149	0,03
Japan 0.70% 21 - 20.03.61	52 200 000	JPY	344 190	267 187	0,04
Japan 0.70% 21 - 20.06.51	35 000 000	JPY	250 535	197 440	0,03
Japan 0.70% 21 - 20.09.51	40 000 000	JPY	255 647	225 062	0,03
Japan 0.70% 22 - 20.12.51	32 000 000	JPY	221 529	179 750	0,03
Japan 0.80% 16 - 20.03.46	35 000 000	JPY	217 111	216 388	0,03
Japan 0.80% 17 - 20.03.47	32 500 000	JPY	264 867	198 410	0,03
Japan 0.80% 17 - 20.06.47	28 600 000	JPY	198 947	174 122	0,03
Japan 0.80% 17 - 20.09.47	28 000 000	JPY	227 541	170 163	0,02
Japan 0.80% 17 - 20.12.47	27 000 000	JPY	180 563	163 394	0,02
Japan 0.80% 18 - 20.03.48	43 900 000	JPY	335 980	264 820	0,04
Japan 0.80% 18 - 20.03.58	30 000 000	JPY	237 111	163 659	0,02
Japan 0.80% 22 - 20.03.42	42 800 000	JPY	319 867	278 528	0,04
Japan 0.80% 23 - 20.09.33	66 100 000	JPY	440 894	476 878	0,07
Japan 0.90% 17 - 20.03.57	41 700 000	JPY	315 591	236 836	0,03
Japan 0.90% 18 - 20.09.48	23 000 000	JPY	161 410	141 222	0,02
Japan 0.90% 22 - 20.06.42	43 000 000	JPY	315 969	283 849	0,04
Japan 1.00% 15 - 20.12.35	60 000 000	JPY	512 637	434 032	0,06
Japan 1.00% 22 - 20.03.52	33 500 000	JPY	249 849	203 626	0,03
Japan 1.00% 22 - 20.03.62	53 600 000	JPY	347 217	301 784	0,04
Japan 1.10% 03 - 20.03.33	5 000 000	JPY	39 501	37 229	0,01
Japan 1.10% 22 - 20.09.42	41 650 000	JPY	301 632	283 892	0,04
Japan 1.10% 23 - 20.03.43	36 600 000	JPY	265 453	248 092	0,04
Japan 1.10% 23 - 20.06.43	47 000 000	JPY	313 939	317 705	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.20% 14 - 20.12.34	40 000 000	JPY	356 426	297 997	0,04
Japan 1.20% 15 - 20.03.35	48 950 000	JPY	436 343	363 740	0,05
Japan 1.20% 15 - 20.09.35	46 000 000	JPY	410 459	341 584	0,05
Japan 1.20% 23 - 20.06.53	26 950 000	JPY	168 669	171 115	0,02
Japan 1.30% 15 - 20.06.35	58 000 000	JPY	522 587	435 638	0,06
Japan 1.30% 22 - 20.06.52	40 000 000	JPY	288 854	261 770	0,04
Japan 1.30% 23 - 20.03.63	18 000 000	JPY	118 202	110 837	0,02
Japan 1.40% 03 - 20.12.32	10 000 000	JPY	80 640	76 168	0,01
Japan 1.40% 14 - 20.09.34	40 000 000	JPY	363 302	303 703	0,04
Japan 1.40% 15 - 20.03.55	26 500 000	JPY	209 212	175 613	0,03
Japan 1.40% 15 - 20.09.45	35 000 000	JPY	321 671	245 837	0,04
Japan 1.40% 15 - 20.12.45	39 000 000	JPY	358 474	272 676	0,04
Japan 1.40% 22 - 20.09.52	38 000 000	JPY	278 050	254 491	0,04
Japan 1.40% 23 - 20.12.42	53 700 000	JPY	401 884	383 964	0,06
Japan 1.40% 23 - 20.03.53	34 000 000	JPY	241 138	227 217	0,03
Japan 1.50% 12 - 20.06.32	15 000 000	JPY	136 028	115 164	0,02
Japan 1.50% 13 - 20.03.33	32 950 000	JPY	299 995	253 569	0,04
Japan 1.50% 14 - 20.03.34	58 750 000	JPY	537 578	451 939	0,07
Japan 1.50% 14 - 20.06.34	50 000 000	JPY	457 872	384 668	0,06
Japan 1.50% 14 - 20.12.44	26 000 000	JPY	243 153	186 450	0,03
Japan 1.50% 15 - 20.03.45	35 000 000	JPY	327 428	250 569	0,04
Japan 1.50% 23 - 20.09.43	39 600 000	JPY	266 262	286 118	0,04
Japan 1.60% 10 - 20.06.30	18 000 000	JPY	161 587	138 334	0,02
Japan 1.60% 12 - 20.03.32	19 000 000	JPY	173 348	146 806	0,02
Japan 1.60% 12 - 20.06.32	15 000 000	JPY	137 068	116 122	0,02
Japan 1.60% 13 - 20.03.33	44 000 000	JPY	349 484	340 721	0,05
Japan 1.60% 13 - 20.12.33	50 000 000	JPY	443 988	387 413	0,06
Japan 1.60% 15 - 20.06.45	37 000 000	JPY	332 038	269 180	0,04
Japan 1.60% 23 - 20.12.52	36 300 000	JPY	291 902	254 440	0,04
Japan 1.70% 03 - 20.06.33	10 000 000	JPY	84 253	78 122	0,01
Japan 1.70% 11 - 20.09.31	15 000 000	JPY	131 643	116 511	0,02
Japan 1.70% 11 - 20.12.31	24 000 000	JPY	220 057	186 614	0,03
Japan 1.70% 12 - 20.03.32	20 000 000	JPY	158 515	155 655	0,02
Japan 1.70% 12 - 20.06.32	20 000 000	JPY	174 575	156 103	0,02
Japan 1.70% 12 - 20.09.32	45 000 000	JPY	415 039	351 168	0,05
Japan 1.70% 12 - 20.12.32	45 000 000	JPY	362 727	351 120	0,05
Japan 1.70% 13 - 20.06.33	61 950 000	JPY	555 551	484 105	0,07
Japan 1.70% 13 - 20.09.33	52 550 000	JPY	488 210	410 690	0,06
Japan 1.70% 13 - 20.12.43	32 000 000	JPY	308 510	239 140	0,03
Japan 1.70% 14 - 20.03.44	15 000 000	JPY	123 807	111 929	0,02
Japan 1.70% 14 - 20.03.54	31 000 000	JPY	293 238	221 901	0,03
Japan 1.70% 14 - 20.06.44	27 000 000	JPY	260 632	200 964	0,03
Japan 1.70% 14 - 20.09.44	25 800 000	JPY	217 379	191 851	0,03
Japan 1.80% 02 - 22.11.32	15 000 000	JPY	134 045	117 947	0,02
Japan 1.80% 10 - 20.06.30	14 000 000	JPY	127 195	108 857	0,02
Japan 1.80% 10 - 20.09.30	13 000 000	JPY	105 883	101 235	0,01
Japan 1.80% 11 - 20.06.31	10 000 000	JPY	83 486	78 137	0,01
Japan 1.80% 11 - 20.09.31	28 550 000	JPY	262 978	223 536	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.80% 12 - 20.12.31	34 400 000	JPY	290 396	269 383	0,04
Japan 1.80% 12 - 20.03.32	32 600 000	JPY	269 107	256 191	0,04
Japan 1.80% 13 - 20.12.32	24 000 000	JPY	223 500	188 740	0,03
Japan 1.80% 13 - 20.03.43	26 500 000	JPY	244 380	201 799	0,03
Japan 1.80% 13 - 20.09.43	24 500 000	JPY	211 560	186 035	0,03
Japan 1.80% 23 - 20.09.53	43 000 000	JPY	300 183	315 043	0,05
Japan 1.90% 05 - 20.03.25	20 000 000	JPY	150 079	145 219	0,02
Japan 1.90% 05 - 20.06.25	25 550 000	JPY	202 412	186 299	0,03
Japan 1.90% 09 - 20.12.28	20 000 000	JPY	159 091	153 816	0,02
Japan 1.90% 09 - 20.03.29	25 000 000	JPY	200 877	192 632	0,03
Japan 1.90% 10 - 20.09.30	39 750 000	JPY	332 142	311 388	0,05
Japan 1.90% 11 - 20.03.31	17 000 000	JPY	156 859	133 538	0,02
Japan 1.90% 11 - 20.06.31	45 000 000	JPY	388 155	353 833	0,05
Japan 1.90% 12 - 20.09.42	41 600 000	JPY	411 549	322 564	0,05
Japan 1.90% 13 - 20.03.53	20 000 000	JPY	190 148	150 101	0,02
Japan 1.90% 13 - 20.06.43	30 050 000	JPY	298 213	232 068	0,03
Japan 2.00% 04 - 20.12.33	20 000 000	JPY	173 429	160 438	0,02
Japan 2.00% 05 - 20.03.25	10 400 000	JPY	80 459	75 605	0,01
Japan 2.00% 05 - 20.06.25	20 000 000	JPY	154 173	146 068	0,02
Japan 2.00% 05 - 20.09.25	12 500 000	JPY	97 711	91 722	0,01
Japan 2.00% 06 - 20.12.25	20 650 000	JPY	176 508	152 230	0,02
Japan 2.00% 07 - 20.03.27	20 000 000	JPY	158 345	150 680	0,02
Japan 2.00% 10 - 20.06.30	16 950 000	JPY	128 137	133 418	0,02
Japan 2.00% 10 - 20.09.40	48 000 000	JPY	476 872	380 381	0,06
Japan 2.00% 11 - 20.12.30	25 000 000	JPY	219 007	197 358	0,03
Japan 2.00% 11 - 20.03.31	25 000 000	JPY	220 131	197 764	0,03
Japan 2.00% 11 - 20.09.41	48 000 000	JPY	479 032	378 648	0,06
Japan 2.00% 12 - 20.03.42	50 000 000	JPY	500 461	394 191	0,06
Japan 2.00% 12 - 20.03.52	25 000 000	JPY	248 779	191 795	0,03
Japan 2.10% 03 - 20.09.33	10 000 000	JPY	86 725	81 045	0,01
Japan 2.10% 05 - 20.03.25	10 000 000	JPY	77 461	72 770	0,01
Japan 2.10% 05 - 20.06.25	11 500 000	JPY	89 553	84 092	0,01
Japan 2.10% 05 - 20.09.25	30 000 000	JPY	236 749	220 408	0,03
Japan 2.10% 05 - 20.12.25	20 000 000	JPY	152 512	147 686	0,02
Japan 2.10% 06 - 20.03.26	25 000 000	JPY	199 680	185 425	0,03
Japan 2.10% 06 - 20.12.26	35 250 000	JPY	307 674	265 300	0,04
Japan 2.10% 07 - 20.03.27	24 550 000	JPY	177 742	185 591	0,03
Japan 2.10% 07 - 20.06.27	15 000 000	JPY	126 736	113 792	0,02
Japan 2.10% 07 - 20.09.27	15 000 000	JPY	118 472	114 239	0,02
Japan 2.10% 07 - 20.12.27	34 250 000	JPY	304 322	261 812	0,04
Japan 2.10% 08 - 20.06.28	10 000 000	JPY	82 180	76 987	0,01
Japan 2.10% 08 - 20.09.28	23 900 000	JPY	197 073	184 502	0,03
Japan 2.10% 08 - 20.12.28	16 900 000	JPY	125 889	130 971	0,02
Japan 2.10% 09 - 20.03.29	25 000 000	JPY	207 272	194 450	0,03
Japan 2.10% 09 - 20.06.29	27 750 000	JPY	252 791	216 717	0,03
Japan 2.10% 09 - 20.09.29	55 850 000	JPY	500 575	437 803	0,06
Japan 2.10% 09 - 20.12.29	28 550 000	JPY	262 112	224 524	0,03
Japan 2.10% 10 - 20.03.30	34 000 000	JPY	313 274	268 479	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.10% 10 - 20.12.30	27 000 000	JPY	230 681	214 705	0,03
Japan 2.20% 01 - 20.05.31	10 000 000	JPY	86 145	80 190	0,01
Japan 2.20% 06 - 20.03.26	15 000 000	JPY	129 381	111 550	0,02
Japan 2.20% 06 - 20.06.26	15 000 000	JPY	129 975	112 083	0,02
Japan 2.20% 06 - 20.09.26	30 000 000	JPY	235 634	225 226	0,03
Japan 2.20% 07 - 20.09.27	15 000 000	JPY	127 762	114 635	0,02
Japan 2.20% 08 - 20.03.28	20 000 000	JPY	158 995	153 991	0,02
Japan 2.20% 08 - 20.09.28	25 000 000	JPY	201 865	193 850	0,03
Japan 2.20% 09 - 20.03.49	18 850 000	JPY	200 403	150 792	0,02
Japan 2.20% 09 - 20.06.29	25 000 000	JPY	219 533	196 191	0,03
Japan 2.20% 09 - 20.09.39	32 750 000	JPY	332 016	267 554	0,04
Japan 2.20% 10 - 20.12.29	20 000 000	JPY	165 842	158 160	0,02
Japan 2.20% 10 - 20.03.30	23 000 000	JPY	177 524	182 566	0,03
Japan 2.20% 10 - 20.03.50	12 000 000	JPY	98 732	96 001	0,01
Japan 2.20% 11 - 20.03.31	10 000 000	JPY	84 033	80 109	0,01
Japan 2.20% 11 - 20.03.41	50 000 000	JPY	469 580	406 292	0,06
Japan 2.20% 11 - 20.03.51	20 000 000	JPY	215 040	159 784	0,02
Japan 2.30% 00 - 20.05.30	10 000 000	JPY	85 568	79 960	0,01
Japan 2.30% 02 - 20.05.32	15 000 000	JPY	128 945	122 161	0,02
Japan 2.30% 05 - 20.03.35	10 000 000	JPY	89 415	82 658	0,01
Japan 2.30% 05 - 20.06.35	11 500 000	JPY	102 909	95 107	0,01
Japan 2.30% 06 - 20.12.35	13 300 000	JPY	119 943	110 128	0,02
Japan 2.30% 06 - 20.03.26	10 000 000	JPY	86 453	74 499	0,01
Japan 2.30% 06 - 20.06.26	20 000 000	JPY	158 653	149 808	0,02
Japan 2.30% 06 - 20.09.26	10 000 000	JPY	78 158	75 262	0,01
Japan 2.30% 07 - 20.12.36	14 000 000	JPY	126 067	116 140	0,02
Japan 2.30% 07 - 20.06.27	31 400 000	JPY	266 368	239 745	0,03
Japan 2.30% 08 - 20.06.28	25 000 000	JPY	225 996	194 035	0,03
Japan 2.30% 09 - 20.03.39	34 000 000	JPY	294 734	281 394	0,04
Japan 2.30% 10 - 20.03.40	30 000 000	JPY	264 737	247 897	0,04
Japan 2.40% 00 - 20.02.30	10 000 000	JPY	83 588	80 117	0,01
Japan 2.40% 01 - 20.11.31	10 000 000	JPY	86 219	81 563	0,01
Japan 2.40% 04 - 20.03.34	13 150 000	JPY	106 546	109 216	0,02
Japan 2.40% 05 - 20.12.34	20 000 000	JPY	175 171	166 675	0,02
Japan 2.40% 07 - 20.03.37	30 000 000	JPY	272 942	251 525	0,04
Japan 2.40% 07 - 20.03.48	12 400 000	JPY	116 633	103 104	0,01
Japan 2.40% 08 - 20.03.28	25 000 000	JPY	225 811	193 976	0,03
Japan 2.40% 08 - 20.06.28	10 000 000	JPY	83 200	77 929	0,01
Japan 2.40% 08 - 20.09.38	41 350 000	JPY	361 124	348 020	0,05
Japan 2.50% 04 - 20.06.34	15 000 000	JPY	132 096	125 977	0,02
Japan 2.50% 04 - 20.09.34	21 000 000	JPY	178 590	176 443	0,03
Japan 2.50% 05 - 20.09.35	12 800 000	JPY	116 906	108 082	0,02
Japan 2.50% 06 - 20.03.36	10 000 000	JPY	91 628	84 508	0,01
Japan 2.50% 06 - 20.06.36	20 000 000	JPY	183 176	169 133	0,02
Japan 2.50% 06 - 20.09.36	5 000 000	JPY	46 534	42 304	0,01
Japan 2.50% 07 - 20.09.37	22 000 000	JPY	227 674	186 480	0,03
Japan 2.50% 08 - 20.03.38	27 200 000	JPY	253 441	230 548	0,03
Japan 2.80% 99 - 20.09.29	5 000 000	JPY	43 929	40 596	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.90% 00 - 20.11.30	15 000 000	JPY	133 965	124 959	0,02
Japan Bank for International Cooperation 0.625% 20 - 15.07.25	200 000	USD	187 664	187 772	0,03
Japan Bank for International Cooperation 1.875% 21 - 15.04.31	140 000	USD	119 992	118 293	0,02
Japan Bank for International Cooperation 2.375% 16 - 20.04.26	200 000	USD	187 385	190 598	0,03
Japan Bank for International Cooperation 2.875% 17 - 01.06.27	200 000	USD	201 391	190 674	0,03
Japan Bank for International Cooperation 2.875% 22 - 14.04.25	250 000	USD	245 154	243 807	0,04
Japan Expressway Holdings and Debt Repayment Agency 0.32% 15 - 31.01.25	10 000 000	JPY	82 255	71 008	0,01
Japan International Cooperation Agency 1.00% 20 - 22.07.30	200 000	USD	151 847	161 484	0,02
Major Joint Local Government Bond 0.05% 16 - 24.07.26	20 000 000	JPY	163 762	141 529	0,02
Major Joint Local Government Bond 0.16% 19 - 25.01.29	30 000 000	JPY	245 717	210 932	0,03
Major Joint Local Government Bond 0.185% 17 - 25.11.27	20 000 000	JPY	164 254	141 650	0,02
Major Joint Local Government Bond 0.245% 18 - 25.08.28	8 000 000	JPY	65 872	56 617	0,01
Major Joint Local Government Bond 0.299% 22 - 23.04.32	20 000 000	JPY	157 675	138 468	0,02
Major Joint Local Government Bond 0.50% 15 - 25.08.25	10 000 000	JPY	79 201	71 138	0,01
Major Joint Local Government Bond 0.548% 15 - 25.06.25	10 000 000	JPY	82 586	71 163	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 1.412% 20 - 17.07.25	150 000	USD	145 754	141 667	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 21 - 13.10.27	100 000	USD	94 541	91 094	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 2.048% 20 - 17.07.30	45 000	USD	40 790	37 784	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 21 - 13.10.32	50 000	USD	45 790	42 066	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 2.757% 16 - 13.09.26	60 000	USD	58 987	56 693	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 3.195% 19 - 18.07.29	60 000	USD	58 624	55 230	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 3.751% 19 - 18.07.39	85 000	USD	74 304	74 621	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 3.85% 16 - 01.03.26	200 000	USD	193 664	195 348	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 3.961% 18 - 02.03.28	45 000	USD	45 579	43 867	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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. 4.286% 18 - 26.07.38	25 000	USD	25 948	23 585	0,00
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 22 - 20.07.33	30 000	USD	30 006	30 513	0,00
Mizuho Financial Group Inc. 0.214% 20 - 07.10.25	100 000	EUR	103 372	104 840	0,02
Mizuho Financial Group Inc. 0.693% 20 - 07.10.30	100 000	EUR	100 852	91 991	0,01
Mizuho Financial Group Inc. FRN 21 - 22.05.27	40 000	USD	36 173	36 471	0,01
Mizuho Financial Group Inc. FRN 20 - 08.09.31	60 000	USD	53 555	49 091	0,01
Mizuho Financial Group Inc. FRN 21 - 22.05.32	25 000	USD	22 362	20 364	0,00
Mizuho Financial Group Inc. FRN 20 - 25.05.26	50 000	USD	47 551	47 802	0,01
Mizuho Financial Group Inc. FRN 19 - 16.07.30	25 000	USD	24 195	22 531	0,00
Mizuho Financial Group Inc. 3.17% 17 - 11.09.27	55 000	USD	54 228	51 715	0,01
Mizuho Financial Group Inc. FRN 22 - 22.05.30	50 000	USD	44 662	45 582	0,01
Mizuho Financial Group Inc. 4.018% 18 - 05.03.28	25 000	USD	25 306	24 287	0,00
Mizuho Financial Group Inc. FRN 18 - 11.09.29	20 000	USD	20 392	19 340	0,00
Mizuho Financial Group Inc. FRN 23 - 06.07.34	80 000	USD	82 919	83 018	0,01
Nomura Holdings Inc. 1.653% 21 - 14.07.26	25 000	USD	23 801	22 854	0,00
Nomura Holdings Inc. 1.851% 20 - 16.07.25	50 000	USD	48 756	47 306	0,01
Nomura Holdings Inc. 2.172% 21 - 14.07.28	20 000	USD	18 587	17 550	0,00
Nomura Holdings Inc. 2.608% 21 - 14.07.31	20 000	USD	18 215	16 622	0,00
Nomura Holdings Inc. 2.648% 20 - 16.01.25	50 000	USD	49 318	48 507	0,01
Nomura Holdings Inc. 2.679% 20 - 16.07.30	100 000	USD	82 756	85 304	0,01
Nomura Holdings Inc. 3.103% 20 - 16.01.30	45 000	USD	42 927	39 838	0,01
Nomura Holdings Inc. 6.087% 23 - 12.07.33	50 000	USD	53 508	53 016	0,01
Norinchukin Bank 144A 1.284% 21 - 22.09.26	50 000	USD	44 242	45 274	0,01
NTT Finance Corp. 0.342% 21 - 03.03.30	100 000	EUR	102 761	95 039	0,01
NTT Finance Corp. 144A 1.162% 21 - 03.04.26	50 000	USD	47 877	46 172	0,01
NTT Finance Corp. 144A 1.591% 21 - 03.04.28	30 000	USD	27 964	26 497	0,00
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.402% 21 - 17.09.26	165 000	USD	156 689	150 358	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.71% 21 - 12.01.31	30 000	USD	26 431	24 253	0,00
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 2.142% 20 - 23.09.30	65 000	USD	58 275	54 070	0,01
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 2.222% 21 - 17.09.31	150 000	USD	120 710	124 003	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 2.296% 21 - 12.01.41	30 000	USD	24 307	20 795	0,00
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 2.348% 20 - 15.01.25	70 000	USD	69 330	67 941	0,01
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 2.632% 16 - 14.07.26	200 000	USD	188 537	189 552	0,03
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 3.202% 19 - 17.09.29	65 000	USD	62 838	59 168	0,01
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 3.352% 17 - 18.10.27	45 000	USD	44 721	42 655	0,01
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 4.306% 18 - 16.10.28	75 000	USD	77 094	73 198	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 144A 1.05% 20 - 12.09.25	10 000	USD	9 649	9 331	0,00
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 144A 1.55% 21 - 25.03.26	20 000	USD	19 276	18 540	0,00
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.00% 20 - 09.07.40	100 000	EUR	104 229	87 641	0,01
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.05% 20 - 31.03.30	100 000	USD	86 050	85 833	0,01
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.175% 20 - 09.07.50	65 000	USD	56 239	46 658	0,01
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.375% 20 - 09.07.60	60 000	USD	51 049	42 249	0,01
			94 713 208	84 764 131	12,39
Jersey					
Aptiv PLC 3.10% 21 - 01.12.51	50 000	USD	39 178	32 720	0,00
Heathrow Funding Ltd. 2.75% 20 - 13.10.29	100 000	GBP	119 529	115 494	0,02
			158 707	148 214	0,02
Kazakhstan					
Kazakhstan 4.875% 14 - 14.10.44	200 000	USD	188 222	192 740	0,03
			188 222	192 740	0,03
Corée					
Kookmin Bank 1.375% 21 - 06.05.26	35 000	USD	33 817	32 268	0,00
Korea 1.125% 19 - 10.09.39	160 000 000	KRW	90 086	92 766	0,01
Korea 1.125% 20 - 10.09.25	157 000 000	KRW	119 071	118 042	0,02
Korea 1.25% 21 - 10.03.26	300 000 000	KRW	225 035	224 160	0,03
Korea 1.375% 19 - 10.12.29	250 000 000	KRW	190 035	175 695	0,03
Korea 1.375% 20 - 10.06.30	258 030 000	KRW	187 076	179 387	0,03
Korea 1.50% 16 - 10.09.36	100 000 000	KRW	70 850	64 472	0,01
Korea 1.50% 16 - 10.12.26	200 000 000	KRW	158 985	148 067	0,02
Korea 1.50% 16 - 10.09.66	70 000 000	KRW	24 508	34 105	0,00
Korea 1.50% 20 - 10.03.25	199 000 000	KRW	161 332	151 932	0,02
Korea 1.50% 20 - 10.03.50	568 000 000	KRW	337 081	318 466	0,05
Korea 1.50% 20 - 10.09.40	200 000 000	KRW	127 897	123 269	0,02
Korea 1.50% 20 - 10.12.30	218 610 000	KRW	154 453	152 034	0,02
Korea 1.625% 20 - 10.09.70	88 030 000	KRW	48 774	43 907	0,01
Korea 1.75% 21 - 10.09.26	150 000 000	KRW	111 903	112 173	0,02
Korea 1.875% 16 - 10.06.26	125 440 000	KRW	97 758	94 462	0,01
Korea 1.875% 19 - 10.06.29	200 000 000	KRW	143 761	145 203	0,02
Korea 1.875% 21 - 10.03.51	630 000 000	KRW	415 404	385 279	0,06
Korea 1.875% 21 - 10.09.41	120 000 000	KRW	72 298	76 959	0,01
Korea 2.00% 16 - 10.03.46	179 000 000	KRW	123 046	115 258	0,02
Korea 2.00% 18 - 10.09.68	100 000 000	KRW	68 421	57 482	0,01
Korea 2.00% 19 - 10.03.49	295 000 000	KRW	211 137	186 959	0,03
Korea 2.00% 21 - 10.06.31	250 000 000	KRW	187 049	179 007	0,03
Korea 2.125% 17 - 10.03.47	236 000 000	KRW	165 213	155 114	0,02
Korea 2.125% 17 - 10.06.27	100 000 000	KRW	74 030	74 950	0,01
Korea 2.25% 15 - 10.06.25	176 000 000	KRW	144 291	134 806	0,02
Korea 2.25% 15 - 10.12.25	150 000 000	KRW	122 748	114 474	0,02
Korea 2.25% 17 - 10.09.37	213 890 000	KRW	140 010	149 236	0,02
Korea 2.375% 17 - 10.12.27	200 000 000	KRW	155 746	150 905	0,02
Korea 2.375% 18 - 10.09.38	110 000 000	KRW	85 714	78 195	0,01
Korea 2.375% 18 - 10.12.28	100 000 000	KRW	73 875	74 834	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Korea 2.375% 21 - 10.12.31	150 000 000	KRW	107 020	109 700	0,02
Korea 2.375% 22 - 10.03.27	320 000 000	KRW	243 694	242 395	0,03
Korea 2.50% 19 - 19.06.29	200 000	USD	199 134	184 392	0,03
Korea 2.50% 22 - 10.03.52	353 000 000	KRW	228 119	242 799	0,03
Korea 2.625% 15 - 10.09.35	160 000 000	KRW	116 116	117 534	0,02
Korea 2.625% 18 - 10.03.48	253 000 000	KRW	203 876	182 204	0,03
Korea 2.625% 18 - 10.06.28	150 000 000	KRW	123 131	114 031	0,02
Korea 2.75% 14 - 10.12.44	167 000 000	KRW	137 406	122 939	0,02
Korea 3.00% 12 - 10.12.42	223 000 000	KRW	189 730	169 718	0,02
Korea 3.125% 22 - 10.06.25	100 000 000	KRW	78 307	77 443	0,01
Korea 3.125% 22 - 10.09.27	150 000 000	KRW	112 394	116 073	0,02
Korea 3.125% 22 - 10.09.52	250 000 000	KRW	176 285	194 494	0,03
Korea 3.125% 23 - 10.06.26	150 000 000	KRW	112 396	116 312	0,02
Korea 3.25% 22 - 10.09.42	100 000 000	KRW	75 941	78 809	0,01
Korea 3.25% 23 - 10.03.28	200 000 000	KRW	151 713	155 590	0,02
Korea 3.25% 23 - 10.03.53	310 000 000	KRW	223 837	247 149	0,04
Korea 3.25% 23 - 10.06.33	150 000 000	KRW	112 529	116 927	0,02
Korea 3.375% 22 - 10.06.32	150 000 000	KRW	101 534	117 670	0,02
Korea 3.375% 23 - 10.03.25	100 000 000	KRW	78 135	77 643	0,01
Korea 3.50% 22 - 10.09.72	80 000 000	KRW	59 600	68 800	0,01
Korea 3.625% 23 - 10.09.25	205 920 000	KRW	156 917	162 717	0,02
Korea 3.75% 13 - 10.12.33	150 000 000	KRW	133 500	122 212	0,02
Korea 4.00% 11 - 10.12.31	253 660 000	KRW	226 782	208 295	0,03
Korea 4.125% 23 - 10.12.33	150 000 000	KRW	125 566	125 820	0,02
Korea 4.25% 22 - 10.12.25	200 000 000	KRW	158 340	158 235	0,02
Korea 4.25% 22 - 10.12.32	200 000 000	KRW	157 801	167 591	0,02
Korea 4.75% 10 - 10.12.30	121 900 000	KRW	113 071	103 977	0,01
Korea 5.25% 07 - 10.03.27	50 000 000	KRW	41 778	41 225	0,01
Korea 5.50% 08 - 10.03.28	169 620 000	KRW	143 421	145 634	0,02
Korea 5.50% 09 - 10.12.29	122 610 000	KRW	116 604	107 370	0,02
Korea 5.75% 06 - 10.03.26	100 000 000	KRW	80 238	81 729	0,01
Korea Development Bank 1.00% 21 - 09.09.26	300 000	USD	286 755	272 004	0,04
LG Chem Ltd. 2.375% 21 - 07.07.31	40 000	USD	36 643	33 148	0,00
Shinhan Financial Group Co. Ltd. FRN 19 - 05.02.30	20 000	USD	19 875	19 457	0,00
			8 949 592	8 745 902	1,28
Lettonie					
Latvia 0.25% 21 - 23.01.30	100 000	EUR	95 741	93 049	0,01
Latvia 3.875% 23 - 22.05.29	50 000	EUR	55 074	57 134	0,01
			150 815	150 183	0,02
Lituanie					
Lithuania 0.50% 20 - 28.07.50	70 000	EUR	57 676	38 650	0,00
			57 676	38 650	0,00
Luxembourg					
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.213% 21 - 12.02.36	100 000	EUR	98 295	85 463	0,01
CNH Industrial Finance Europe SA 1.625% 19 - 03.07.29	100 000	EUR	108 355	100 528	0,01
CPI Property Group SA 1.75% 22 - 14.01.30	100 000	EUR	72 057	62 966	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
DH Europe Finance II Sarl 0.75% 19 - 18.09.31	100 000	EUR	102 773	93 105	0,01
DH Europe Finance II Sarl 3.25% 19 - 15.11.39	125 000	USD	118 041	103 898	0,01
European Financial Stability Facility Zero Coupon 20 - 15.10.25	60 000	EUR	65 506	63 275	0,01
European Financial Stability Facility Zero Coupon 20 - 13.10.27	100 000	EUR	107 226	100 906	0,01
European Financial Stability Facility Zero Coupon 21 - 20.01.31	66 000	EUR	68 044	61 117	0,01
European Financial Stability Facility 0.05% 19 - 17.10.29	66 000	EUR	69 400	63 525	0,01
European Financial Stability Facility 0.20% 15 - 28.04.25	60 000	EUR	65 865	63 976	0,01
European Financial Stability Facility 0.40% 16 - 31.05.26	110 000	EUR	120 699	115 751	0,02
European Financial Stability Facility 0.40% 18 - 17.02.25	150 000	EUR	157 261	160 993	0,02
European Financial Stability Facility 0.40% 19 - 26.01.26	100 000	EUR	109 871	105 745	0,02
European Financial Stability Facility 0.625% 18 - 16.10.26	90 000	EUR	99 221	94 547	0,01
European Financial Stability Facility 0.70% 20 - 20.01.50	51 000	EUR	49 874	33 205	0,00
European Financial Stability Facility 0.875% 22 - 05.09.28	100 000	EUR	99 125	102 968	0,01
European Financial Stability Facility 0.95% 18 - 14.02.28	66 000	EUR	73 384	68 740	0,01
European Financial Stability Facility 1.25% 17 - 24.05.33	100 000	EUR	93 441	97 885	0,01
European Financial Stability Facility 1.375% 16 - 31.05.47	58 000	EUR	65 857	47 139	0,01
European Financial Stability Facility 1.45% 17 - 05.09.40	58 000	EUR	65 822	51 539	0,01
European Financial Stability Facility 1.75% 18 - 17.07.53	55 000	EUR	68 354	45 497	0,01
European Financial Stability Facility 1.80% 17 - 10.07.48	62 000	EUR	76 844	54 069	0,01
European Financial Stability Facility 2.00% 17 - 28.02.56	50 000	EUR	66 262	43 394	0,01
European Financial Stability Facility 2.35% 14 - 29.07.44	120 000	EUR	158 879	119 940	0,02
European Financial Stability Facility 2.375% 22 - 21.06.32	100 000	EUR	105 011	108 423	0,02
European Financial Stability Facility 2.375% 22 - 11.04.28	100 000	EUR	97 359	110 319	0,02
European Financial Stability Facility 2.875% 23 - 16.02.33	100 000	EUR	106 831	112 747	0,02
European Financial Stability Facility 3.00% 13 - 04.09.34	100 000	EUR	130 875	113 149	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
European Financial Stability Facility 3.00% 23 - 15.12.28	100 000	EUR	110 485	113 251	0,02
European Financial Stability Facility 3.00% 23 - 10.07.30	100 000	EUR	107 240	113 613	0,02
European Financial Stability Facility 3.375% 12 - 03.04.37	45 000	EUR	62 637	52 462	0,01
Grand City Properties SA 0.125% 21 - 11.01.28	100 000	EUR	100 860	92 701	0,01
Holcim Finance Luxembourg SA 0.625% 21 - 06.04.30	100 000	EUR	100 277	93 721	0,01
John Deere Cash Management SARL 1.85% 20 - 02.04.28	100 000	EUR	113 165	106 715	0,02
Luxembourg Zero Coupon 19 - 13.11.26	100 000	EUR	102 814	103 310	0,01
Luxembourg 2.25% 13 - 19.03.28	60 000	EUR	70 175	66 076	0,01
Medtronic Global Holdings SCA 1.375% 20 - 15.10.40	100 000	EUR	67 930	80 987	0,01
Medtronic Global Holdings SCA 2.625% 22 - 15.10.25	100 000	EUR	97 271	109 035	0,02
Medtronic Global Holdings SCA 3.125% 22 - 15.10.31	100 000	EUR	94 376	110 846	0,02
Nestle Finance International Ltd. Zero Coupon 21 - 14.06.26	100 000	EUR	107 801	103 624	0,01
Nestle Finance International Ltd. 0.25% 21 - 14.06.29	50 000	EUR	47 525	48 844	0,01
Nestle Finance International Ltd. 0.875% 21 - 14.06.41	60 000	EUR	56 769	47 674	0,01
Novartis Finance SA Zero Coupon 20 - 23.09.28	100 000	EUR	104 372	97 731	0,01
Richemont International Holdings SA 2.00% 18 - 26.03.38	100 000	EUR	112 147	95 566	0,01
			4 076 376	3 820 965	0,56
Malaisie					
Malaysia Zero Coupon 22 - 15.07.32	250 000	MYR	58 230	53 491	0,01
Malaysia 2.632% 20 - 15.04.31	450 000	MYR	95 688	90 795	0,01
Malaysia 3.422% 20 - 30.09.27	300 000	MYR	70 796	64 940	0,01
Malaysia 3.447% 21 - 15.07.36	300 000	MYR	61 143	61 989	0,01
Malaysia 3.465% 20 - 15.10.30	450 000	MYR	104 115	96 141	0,01
Malaysia 3.502% 07 - 31.05.27	600 000	MYR	142 202	130 467	0,02
Malaysia 3.519% 23 - 20.04.28	200 000	MYR	43 853	43 425	0,01
Malaysia 3.599% 23 - 31.07.28	170 000	MYR	36 477	36 995	0,00
Malaysia 3.726% 19 - 31.03.26	600 000	MYR	134 908	131 305	0,02
Malaysia 3.733% 13 - 15.06.28	300 000	MYR	66 822	65 666	0,01
Malaysia 3.757% 19 - 22.05.40	350 000	MYR	72 838	72 952	0,01
Malaysia 3.828% 19 - 05.07.34	250 000	MYR	55 691	54 134	0,01
Malaysia 3.844% 13 - 15.04.33	350 000	MYR	81 260	76 282	0,01
Malaysia 3.882% 18 - 14.03.25	300 000	MYR	63 404	65 710	0,01
Malaysia 3.885% 19 - 15.08.29	300 000	MYR	67 848	65 937	0,01
Malaysia 3.899% 17 - 16.11.27	660 000	MYR	142 245	145 394	0,02
Malaysia 3.90% 16 - 30.11.26	300 000	MYR	67 355	66 062	0,01
Malaysia 3.906% 19 - 15.07.26	150 000	MYR	34 541	32 988	0,00
Malaysia 3.955% 15 - 15.09.25	500 000	MYR	120 043	109 863	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Malaisie (suite)					
Malaysia 4.065% 20 - 15.06.50	450 000	MYR	99 540	95 425	0,01
Malaysia 4.07% 16 - 30.09.26	400 000	MYR	96 332	88 364	0,01
Malaysia 4.119% 19 - 30.11.34	400 000	MYR	93 823	88 953	0,01
Malaysia 4.127% 12 - 15.04.32	100 000	MYR	22 646	22 241	0,00
Malaysia 4.128% 18 - 15.08.25	200 000	MYR	45 736	44 051	0,01
Malaysia 4.13% 19 - 09.07.29	300 000	MYR	72 357	66 675	0,01
Malaysia 4.193% 22 - 07.10.32	150 000	MYR	34 385	33 538	0,00
Malaysia 4.232% 11 - 30.06.31	100 000	MYR	23 083	22 380	0,00
Malaysia 4.245% 15 - 30.09.30	200 000	MYR	45 951	44 763	0,01
Malaysia 4.254% 15 - 31.05.35	100 000	MYR	22 990	22 390	0,00
Malaysia 4.258% 17 - 26.07.27	100 000	MYR	23 007	22 264	0,00
Malaysia 4.291% 23 - 14.08.43	250 000	MYR	55 498	55 739	0,01
Malaysia 4.369% 18 - 31.10.28	350 000	MYR	85 206	78 659	0,01
Malaysia 4.392% 11 - 15.04.26	160 000	MYR	38 789	35 551	0,00
Malaysia 4.417% 21 - 30.09.41	300 000	MYR	68 057	67 607	0,01
Malaysia 4.457% 23 - 31.03.53	200 000	MYR	44 345	45 087	0,01
Malaysia 4.467% 19 - 15.09.39	550 000	MYR	130 433	125 130	0,02
Malaysia 4.498% 10 - 15.04.30	300 000	MYR	70 539	68 097	0,01
Malaysia 4.504% 22 - 30.04.29	200 000	MYR	46 207	45 301	0,01
Malaysia 4.582% 13 - 30.08.33	250 000	MYR	61 667	57 918	0,01
Malaysia 4.638% 19 - 15.11.49	200 000	MYR	45 721	45 531	0,01
Malaysia 4.642% 18 - 07.11.33	200 000	MYR	47 893	46 762	0,01
Malaysia 4.662% 22 - 31.03.38	200 000	MYR	42 028	46 886	0,01
Malaysia 4.696% 22 - 15.10.42	200 000	MYR	41 657	46 870	0,01
Malaysia 4.724% 17 - 15.06.33	100 000	MYR	22 999	23 287	0,00
Malaysia 4.736% 16 - 15.03.46	200 000	MYR	48 645	46 657	0,01
Malaysia 4.755% 17 - 04.08.37	300 000	MYR	74 140	70 556	0,01
Malaysia 4.762% 17 - 07.04.37	500 000	MYR	118 685	117 397	0,02
Malaysia 4.786% 15 - 31.10.35	100 000	MYR	23 244	23 518	0,00
Malaysia 4.893% 18 - 08.06.38	200 000	MYR	46 220	47 849	0,01
Malaysia 4.895% 17 - 08.05.47	300 000	MYR	72 164	71 271	0,01
Malaysia 4.921% 18 - 06.07.48	440 000	MYR	106 240	105 948	0,01
Malaysia 4.943% 13 - 06.12.28	200 000	MYR	46 894	46 018	0,01
Malaysia 5.357% 22 - 15.05.52	150 000	MYR	39 047	38 074	0,01
			3 475 627	3 371 293	0,49
Mexique					
America Movil SAB de CV 3.625% 19 - 22.04.29	50 000	USD	47 425	47 305	0,01
America Movil SAB de CV 4.375% 12 - 16.07.42	50 000	USD	45 473	45 209	0,01
America Movil SAB de CV 6.125% 10 - 30.03.40	50 000	USD	52 094	54 450	0,01
Coca-Cola Femsa SAB de CV 1.85% 20 - 01.09.32	25 000	USD	22 177	19 911	0,00
Fomento Economico Mexicano SAB de CV 3.50% 20 - 16.01.50	60 000	USD	54 487	45 716	0,01
Orbia Advance Corp. SAB de CV 5.875% 14 - 17.09.44	50 000	USD	45 960	44 878	0,00
			267 616	257 469	0,04
Pays-Bas					
ABN AMRO Bank NV 0.40% 21 - 17.09.41	100 000	EUR	93 083	69 470	0,01
ABN AMRO Bank NV 0.875% 18 - 22.04.25	100 000	EUR	110 395	106 806	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
ABN AMRO Bank NV 1.25% 18 - 10.01.33	100 000	EUR	95 457	96 810	0,01
ABN AMRO Bank NV 1.25% 22 - 20.01.34	100 000	EUR	89 192	89 414	0,01
ABN AMRO Bank NV 3.75% 23 - 20.04.25	100 000	EUR	110 471	110 879	0,02
Achmea Bank NV 0.01% 20 - 16.06.25	100 000	EUR	104 946	105 485	0,02
Achmea BV 3.625% 22 - 29.11.25	100 000	EUR	109 207	110 936	0,02
Adecco International Financial Services BV 0.125% 21 - 21.09.28	100 000	EUR	102 325	97 875	0,01
Aegon Bank NV 0.375% 21 - 09.06.36	100 000	EUR	97 600	80 632	0,01
Akzo Nobel NV 2.00% 22 - 28.03.32	100 000	EUR	99 287	99 128	0,01
Allianz Finance II BV Zero Coupon 20 - 14.01.25	100 000	EUR	109 430	106 763	0,02
Allianz Finance II BV 0.50% 20 - 14.01.31	100 000	EUR	102 498	95 284	0,01
ASML Holdings NV 0.625% 20 - 07.05.29	100 000	EUR	106 358	98 853	0,01
BMW Finance NV 0.20% 21 - 11.01.33	60 000	EUR	57 899	52 206	0,01
BMW Finance NV 0.875% 17 - 03.04.25	80 000	EUR	88 196	85 740	0,01
BNG Bank NV 0.125% 19 - 11.04.26	100 000	EUR	108 781	104 547	0,02
BNG Bank NV 0.125% 20 - 09.07.35	112 000	EUR	109 128	91 565	0,01
BNG Bank NV 0.25% 15 - 07.05.25	49 000	EUR	53 771	52 208	0,01
BNG Bank NV 0.75% 18 - 11.01.28	100 000	EUR	109 905	103 228	0,01
BNG Bank NV 1.00% 16 - 12.01.26	62 000	EUR	68 897	66 243	0,01
BNG Bank NV 1.50% 18 - 15.07.39	100 000	EUR	79 307	89 837	0,01
BNG Bank NV 3.00% 23 - 23.02.28	100 000	EUR	109 773	112 831	0,02
BNG Bank NV 3.25% 15 - 15.07.25	100 000	AUD	68 964	67 140	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 0.625% 21 - 25.02.33	100 000	EUR	82 192	88 009	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 0.75% 22 - 02.03.32	100 000	EUR	89 028	94 304	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 1.25% 16 - 23.03.26	100 000	EUR	111 029	106 491	0,02
Cooperatieve Rabobank UA 1.25% 20 - 14.01.25	100 000	GBP	129 901	122 669	0,02
Cooperatieve Rabobank UA 1.375% 15 - 03.02.27	100 000	EUR	111 345	105 030	0,02
Cooperatieve Rabobank UA 1.50% 18 - 26.04.38	100 000	EUR	111 659	91 031	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 3.375% 15 - 21.05.25	40 000	USD	39 261	39 215	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 4.375% 15 - 04.08.25	45 000	USD	45 386	44 202	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 5.25% 11 - 24.05.41	35 000	USD	42 204	37 114	0,01
Daimler Truck International Finance BV 1.25% 22 - 06.04.25	100 000	EUR	106 275	107 402	0,02
de Volksbank NV 0.75% 17 - 18.05.27	100 000	EUR	109 545	103 782	0,01
Deutsche Telekom International Finance BV 1.50% 16 - 03.04.28	100 000	EUR	100 213	104 806	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 8.75% 00 - 15.06.30	100 000	USD	126 635	120 587	0,02
DSM BV 0.25% 20 - 23.06.28	100 000	EUR	105 269	99 433	0,01
Euronext NV 1.125% 19 - 12.06.29	100 000	EUR	107 382	100 862	0,01
EXOR NV 1.75% 18 - 18.01.28	100 000	EUR	110 091	105 710	0,02
H&M Finance BV 4.875% 23 - 25.10.31	100 000	EUR	116 886	118 013	0,02
ING Bank NV 2.50% 22 - 21.02.30	100 000	EUR	104 607	109 212	0,02
ING Groep NV FRN 21 - 29.09.28	100 000	EUR	97 607	98 056	0,01
ING Groep NV FRN 21 - 01.04.27	45 000	USD	42 743	41 653	0,01
ING Groep NV 2.50% 18 - 15.11.30	100 000	EUR	114 552	105 758	0,02
ING Groep NV FRN 21 - 01.04.32	65 000	USD	54 703	55 856	0,01
ING Groep NV 4.05% 19 - 09.04.29	20 000	USD	20 160	19 345	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
ING Groep NV 4.55% 18 - 02.10.28	25 000	USD	25 680	24 706	0,00
ING Groep NV FRN 22 - 14.11.33	100 000	EUR	110 460	121 270	0,02
JDE Peet's NV 0.244% 21 - 16.01.25	100 000	EUR	108 869	106 330	0,02
Koninklijke KPN NV 0.625% 16 - 09.04.25	100 000	EUR	109 594	106 519	0,02
Linde Finance BV 0.55% 20 - 19.05.32	100 000	EUR	102 486	91 487	0,01
Lseg Netherlands BV 4.125% 23 - 29.09.26	100 000	EUR	110 665	113 311	0,02
LYB International Finance BV 5.25% 13 - 15.07.43	25 000	USD	27 351	23 967	0,00
LyondellBasell Industries NV 4.625% 15 - 26.02.55	25 000	USD	25 141	21 814	0,00
Mercedes-Benz International Finance BV 0.625% 19 - 06.05.27	70 000	EUR	75 627	71 991	0,01
Mercedes-Benz International Finance BV 2.00% 20 - 22.08.26	100 000	EUR	102 423	108 167	0,02
Mercedes-Benz International Finance BV 2.625% 20 - 07.04.25	60 000	EUR	67 540	65 649	0,01
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.625% 21 - 09.09.32	100 000	EUR	99 562	89 167	0,01
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.01% 20 - 08.07.30	100 000	EUR	102 438	92 490	0,01
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.375% 19 - 26.02.25	100 000	EUR	109 316	106 425	0,02
Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV 3.00% 22 - 25.10.27	100 000	EUR	107 990	112 920	0,02
Nederlandse Waterschapsbank NV 0.75% 16 - 04.10.41	100 000	EUR	100 813	75 789	0,01
Nederlandse Waterschapsbank NV 1.00% 18 - 01.03.28	100 000	EUR	110 828	103 889	0,01
Nederlandse Waterschapsbank NV 1.25% 16 - 27.05.36	100 000	EUR	109 528	92 120	0,01
Nederlandse Waterschapsbank NV 3.00% 23 - 20.04.33	100 000	EUR	107 992	113 703	0,02
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.07.30	150 000	EUR	158 855	144 193	0,02
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.27	150 000	EUR	163 370	155 237	0,02
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.52	240 000	EUR	165 118	136 694	0,02
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.07.31	150 000	EUR	157 287	140 697	0,02
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.38	100 000	EUR	87 532	78 199	0,01
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.29	100 000	EUR	87 881	99 357	0,01
Netherlands 144A Zero Coupon 22 - 15.01.26	170 000	EUR	171 708	178 953	0,03
Netherlands 144A 0.25% 15 - 15.07.25	177 000	EUR	187 851	188 832	0,03
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	200 000	EUR	200 782	199 573	0,03
Netherlands 144A 0.50% 16 - 15.07.26	226 000	EUR	236 626	239 176	0,03
Netherlands 144A 0.50% 19 - 15.01.40	210 000	EUR	175 021	171 980	0,02
Netherlands 144A 0.50% 22 - 15.07.32	240 000	EUR	223 081	228 896	0,03
Netherlands 144A 0.75% 17 - 15.07.27	200 000	EUR	210 836	210 692	0,03
Netherlands 144A 0.75% 18 - 15.07.28	150 000	EUR	160 196	155 978	0,02
Netherlands 144A 2.00% 22 - 15.01.54	60 000	EUR	56 315	59 859	0,01
Netherlands 144A 2.50% 12 - 15.01.33	180 000	EUR	228 706	202 396	0,03
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.07.33	150 000	EUR	159 705	168 150	0,02
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.01.30	100 000	EUR	109 748	112 571	0,02
Netherlands 144A 2.75% 14 - 15.01.47	223 000	EUR	348 240	258 326	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 3.25% 23 - 15.01.44	80 000	EUR	91 097	98 409	0,01
Netherlands 144A 3.75% 10 - 15.01.42	205 000	EUR	336 107	267 181	0,04
Netherlands 144A 4.00% 05 - 15.01.37	200 000	EUR	286 272	257 863	0,04
Netherlands 144A 5.50% 98 - 15.01.28	200 000	EUR	240 065	249 149	0,04
NIBC Bank NV 0.875% 22 - 24.06.27	100 000	EUR	96 232	100 608	0,01
NN Group NV FRN 23 - 03.11.43	100 000	EUR	116 474	117 747	0,02
NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc. 2.50% 22 - 11.05.31	25 000	USD	22 914	21 250	0,00
NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc. 2.65% 22 - 15.02.32	25 000	USD	22 875	21 101	0,00
NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc. 3.25% 22 - 11.05.41	25 000	USD	22 119	19 096	0,00
NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc. 3.40% 22 - 01.05.30	25 000	USD	24 303	22 997	0,00
NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc. 3.875% 22 - 18.06.26	25 000	USD	25 063	24 356	0,00
NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc. 4.30% 22 - 18.06.29	25 000	USD	25 646	24 309	0,00
Prosus NV 2.031% 20 - 03.08.32	100 000	EUR	92 355	84 682	0,01
Prosus NV 3.061% 21 - 13.07.31	50 000	USD	42 426	40 345	0,01
Prosus NV 3.832% 20 - 08.02.51	20 000	USD	12 753	12 608	0,00
Prosus NV 4.193% 22 - 19.01.32	40 000	USD	33 417	34 469	0,00
Prosus NV 4.987% 22 - 19.01.52	50 000	USD	37 196	37 453	0,01
Roche Finance Europe BV 3.355% 23 - 27.02.35	100 000	EUR	114 122	115 281	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 20 - 20.02.26	100 000	EUR	108 135	104 070	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.50% 20 - 20.02.32	100 000	EUR	103 141	91 474	0,01
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.00% 20 - 20.02.25	100 000	GBP	130 001	122 219	0,02
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.00% 22 - 08.09.33	100 000	EUR	102 179	110 472	0,02
Telefonica Europe BV 8.25% 00 - 15.09.30	20 000	USD	24 643	23 466	0,00
TenneT Holdings BV 0.50% 21 - 09.06.31	100 000	EUR	102 208	98 515	0,01
TenneT Holdings BV 4.25% 22 - 28.04.32	100 000	EUR	100 872	119 794	0,02
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 21 - 18.10.41	150 000	EUR	150 371	124 832	0,02
Unilever Finance Netherlands BV 1.25% 20 - 25.03.25	100 000	EUR	101 577	107 706	0,02
Wolters Kluwer NV 3.75% 23 - 03.04.31	100 000	EUR	109 039	114 561	0,02
WPC Eurobond BV 2.125% 18 - 15.04.27	100 000	EUR	110 123	104 877	0,02
			12 050 429	11 554 783	1,69
Nouvelle-Zélande					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 144A 1.25% 21 - 22.06.26	45 000	USD	42 995	41 190	0,01
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 144A 2.55% 20 - 13.02.30	15 000	USD	14 298	13 028	0,00
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 144A 3.45% 17 - 17.07.27	10 000	USD	10 057	9 538	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 144A 3.45% 18 - 21.01.28	10 000	USD	10 027	9 487	0,00
ASB Bank Ltd. 4.50% 23 - 16.03.27	100 000	EUR	110 213	114 033	0,02
Bank of New Zealand 3.708% 23 - 20.12.28	100 000	EUR	108 791	113 937	0,02
New Zealand 0.25% 20 - 15.05.28	100 000	NZD	54 409	53 461	0,01
New Zealand 0.50% 21 - 15.05.26	200 000	NZD	113 227	115 635	0,02
New Zealand 1.50% 19 - 15.05.31	300 000	NZD	184 521	156 982	0,02
New Zealand 1.75% 20 - 15.05.41	60 000	NZD	28 527	25 006	0,00
New Zealand 2.00% 21 - 15.05.32	50 000	NZD	26 294	26 584	0,00
New Zealand 2.75% 16 - 15.04.25	120 000	NZD	83 299	73 873	0,01
New Zealand 2.75% 16 - 15.04.37	200 000	NZD	129 790	104 092	0,02
New Zealand 2.75% 21 - 15.05.51	100 000	NZD	46 725	45 152	0,01
New Zealand 3.00% 18 - 20.04.29	150 000	NZD	103 184	89 809	0,01
New Zealand 3.50% 15 - 14.04.33	240 000	NZD	147 451	142 354	0,02
New Zealand 4.25% 22 - 15.05.34	100 000	NZD	62 173	62 636	0,01
New Zealand 4.50% 14 - 15.04.27	150 000	NZD	109 050	95 617	0,01
New Zealand 4.50% 15 - 15.04.27	150 000	NZD	107 219	94 588	0,01
New Zealand 4.50% 23 - 15.05.30	150 000	NZD	95 126	96 468	0,01
New Zealand Local Government Funding Agency Bond 5.10% 23 - 28.11.30	100 000	AUD	66 633	70 413	0,01
Westpac Securities NZ Ltd. 0.10% 21 - 13.07.27	100 000	EUR	104 730	98 826	0,02
			1 758 739	1 652 709	0,24
Norvège					
DNB Bank ASA FRN 22 - 21.09.27	140 000	EUR	149 083	154 159	0,02
DNB Boligkreditt AS 0.625% 19 - 14.01.26	100 000	EUR	109 776	105 491	0,01
Eika Boligkreditt AS 0.50% 18 - 28.08.25	100 000	EUR	103 119	105 956	0,02
Kommunalbanken AS 144A 1.125% 21 - 26.10.26	300 000	USD	289 036	275 328	0,04
Kommunalbanken AS 144A 4.00% 23 - 19.01.28	200 000	USD	196 182	199 150	0,03
Norway 144A 1.25% 21 - 17.09.31	800 000	NOK	84 002	68 158	0,01
Norway 144A 1.375% 20 - 19.08.30	1 800 000	NOK	193 237	157 381	0,02
Norway 144A 1.75% 15 - 13.03.25	1 000 000	NOK	114 568	96 063	0,01
Norway 144A 1.75% 19 - 06.09.29	500 000	NOK	47 983	45 384	0,01
Norway 144A 2.00% 18 - 26.04.28	600 000	NOK	67 815	56 125	0,01
Norway 144A 2.125% 22 - 18.05.32	500 000	NOK	41 103	45 109	0,01
Norway 144A 3.00% 23 - 15.08.33	400 000	NOK	37 774	38 534	0,01
Norway 144A 3.50% 22 - 06.10.42	400 000	NOK	39 817	41 475	0,01
SpareBank 1 Boligkreditt AS 0.05% 21 - 03.11.28	100 000	EUR	104 965	96 792	0,01
SR-Boligkreditt AS 0.01% 21 - 10.03.31	100 000	EUR	101 451	89 983	0,01
Telenor ASA 1.125% 19 - 31.05.29	100 000	EUR	107 957	100 387	0,01
			1 787 868	1 675 475	0,24
Panama					
Panama 2.252% 20 - 29.09.32	250 000	USD	224 553	182 935	0,03
Panama 3.298% 22 - 19.01.33	200 000	USD	181 662	158 412	0,02
Panama 3.75% 15 - 16.03.25	45 000	USD	44 828	43 717	0,01
Panama 3.87% 19 - 23.07.60	100 000	USD	67 600	59 886	0,01
Panama 4.50% 18 - 16.04.50	150 000	USD	143 915	103 945	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Panama (suite)					
Panama 6.40% 22 - 14.02.35	100 000	USD	100 890	97 683	0,01
Panama 6.70% 06 - 26.01.36	213 000	USD	230 749	211 637	0,03
			994 197	858 215	0,12
Pérou					
Banco de Credito del Peru S.A. 2.70% 19 - 11.01.25	10 000	USD	9 947	9 704	0,00
Banco de Credito del Peru S.A. FRN 20 - 01.07.30	25 000	USD	24 097	23 652	0,00
Banco de Credito del Peru S.A. FRN 21 - 30.09.31	20 000	USD	19 093	18 279	0,00
Peru 2.75% 15 - 30.01.26	100 000	EUR	113 208	108 184	0,02
Peru 2.78% 20 - 01.12.60	200 000	USD	133 475	124 354	0,02
Peru 2.783% 20 - 23.01.31	100 000	USD	90 012	87 113	0,01
Peru 3.00% 21 - 15.01.34	200 000	USD	167 041	168 758	0,03
Peru 3.30% 21 - 11.03.41	200 000	USD	178 701	155 244	0,02
Peru 5.40% 19 - 12.08.34	220 000	PEN	53 855	53 812	0,01
Peru 5.625% 10 - 18.11.50	100 000	USD	101 568	103 962	0,02
Peru 6.15% 17 - 12.08.32	432 000	PEN	110 716	114 079	0,02
Peru 6.35% 16 - 12.08.28	418 000	PEN	111 573	115 513	0,02
Peru 6.714% 14 - 12.02.55	106 000	PEN	26 714	28 355	0,00
Peru 6.90% 07 - 12.08.37	45 000	PEN	104 716	12 254	0,00
Peru 6.95% 08 - 12.08.31	350 000	PEN	93 418	97 657	0,01
Peru 7.35% 05 - 21.07.25	200 000	USD	209 310	206 532	0,03
			1 547 444	1 427 452	0,21
Pologne					
Bank Gospodarstwa Krajowego 0.375% 21 - 13.10.28	100 000	EUR	102 851	94 382	0,01
Bank Gospodarstwa Krajowego 1.75% 16 - 06.05.26	100 000	EUR	111 066	106 041	0,02
Poland 0.25% 21 - 25.10.26	800 000	PLN	159 184	178 908	0,03
Poland 0.75% 20 - 25.04.25	300 000	PLN	58 023	72 233	0,01
Poland 1.00% 19 - 07.03.29	100 000	EUR	96 078	101 694	0,01
Poland 1.25% 20 - 25.10.30	650 000	PLN	118 770	130 845	0,02
Poland 1.75% 21 - 25.04.32	660 000	PLN	107 016	130 520	0,02
Poland 2.50% 15 - 25.07.26	700 000	PLN	155 456	167 710	0,02
Poland 2.50% 16 - 25.07.27	650 000	PLN	137 033	152 793	0,02
Poland 2.75% 13 - 25.04.28	705 000	PLN	144 869	164 494	0,02
Poland 2.75% 19 - 25.10.29	946 000	PLN	195 331	214 913	0,03
Poland 2.75% 22 - 25.05.32	50 000	EUR	48 140	53 365	0,01
Poland 3.25% 14 - 25.07.25	610 000	PLN	136 997	151 032	0,02
Poland 3.625% 23 - 29.11.30	100 000	EUR	109 756	113 696	0,02
Poland 3.75% 22 - 25.05.27	400 000	PLN	86 064	98 025	0,01
Poland 4.875% 23 - 04.10.33	130 000	USD	131 978	131 620	0,02
Poland 5.50% 23 - 04.04.53	110 000	USD	109 143	114 517	0,02
Poland 5.75% 08 - 25.04.29	400 000	PLN	97 434	105 108	0,02
Poland 6.00% 22 - 25.10.33	480 000	PLN	119 165	129 416	0,02
Poland 7.50% 22 - 25.07.28	470 000	PLN	121 709	131 566	0,02
			2 346 063	2 542 878	0,37
Portugal					
Portugal 144A 0.30% 21 - 17.10.31	72 000	EUR	73 523	67 084	0,01
Portugal 144A 0.475% 20 - 18.10.30	170 000	EUR	161 266	165 087	0,02
Portugal 144A 0.70% 20 - 15.10.27	100 000	EUR	97 653	104 469	0,02
Portugal 144A 0.90% 20 - 12.10.35	30 000	EUR	25 422	26 594	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.00% 21 - 12.04.52	65 000	EUR	43 957	41 672	0,01
Portugal 144A 1.15% 22 - 11.04.42	40 000	EUR	34 381	31 850	0,00
Portugal 144A 1.65% 22 - 16.07.32	150 000	EUR	145 135	153 482	0,02
Portugal 144A 1.95% 19 - 15.06.29	129 000	EUR	149 352	140 016	0,02
Portugal 144A 2.125% 18 - 17.10.28	178 000	EUR	200 349	195 711	0,03
Portugal 144A 2.25% 18 - 18.04.34	60 000	EUR	71 135	63 297	0,01
Portugal 144A 2.875% 15 - 15.10.25	154 000	EUR	177 555	171 428	0,02
Portugal 144A 2.875% 16 - 21.07.26	127 000	EUR	148 629	142 803	0,02
Portugal 144A 3.50% 23 - 18.06.38	32 000	EUR	34 714	36 905	0,01
Portugal 144A 3.875% 14 - 15.02.30	100 000	EUR	119 369	119 760	0,02
Portugal 144A 4.10% 06 - 15.04.37	160 000	EUR	228 256	197 200	0,03
Portugal 144A 4.10% 15 - 15.02.45	46 000	EUR	71 074	57 700	0,01
Portugal 144A 4.125% 17 - 14.04.27	120 000	EUR	147 792	140 307	0,02
			1 929 562	1 855 365	0,27
Qatar					
Qatar 3.25% 16 - 02.06.26	300 000	USD	304 759	291 819	0,04
Qatar 3.75% 20 - 16.04.30	200 000	USD	209 988	195 438	0,03
Qatar 4.00% 19 - 14.03.29	200 000	USD	200 136	198 648	0,03
Qatar 4.40% 20 - 16.04.50	200 000	USD	192 240	185 100	0,02
Qatar 4.817% 19 - 14.03.49	200 000	USD	229 963	195 026	0,03
Qatar 5.103% 18 - 23.04.48	200 000	USD	183 093	202 944	0,03
			1 320 179	1 268 975	0,18
Roumanie					
Romania 1.375% 20 - 02.12.29	100 000	EUR	83 574	90 993	0,01
Romania 2.00% 19 - 08.12.26	90 000	EUR	94 086	93 494	0,01
Romania 2.00% 21 - 14.04.33	90 000	EUR	81 672	74 387	0,01
Romania 2.50% 21 - 25.10.27	200 000	RON	39 982	38 971	0,01
Romania 2.625% 20 - 02.12.40	40 000	EUR	34 197	29 690	0,01
Romania 2.875% 16 - 26.05.28	90 000	EUR	97 632	92 935	0,01
Romania 3.00% 20 - 14.02.31	360 000	USD	319 470	306 623	0,05
Romania 3.25% 20 - 24.06.26	100 000	RON	19 913	20 771	0,00
Romania 3.375% 18 - 08.02.38	30 000	EUR	28 738	25 898	0,00
Romania 3.375% 20 - 28.01.50	21 000	EUR	18 476	15 783	0,00
Romania 3.624% 20 - 26.05.30	70 000	EUR	75 222	71 051	0,01
Romania 3.65% 16 - 24.09.31	500 000	RON	94 575	93 497	0,01
Romania 3.65% 20 - 28.07.25	200 000	RON	40 773	42 882	0,01
Romania 3.75% 22 - 07.02.34	100 000	EUR	88 623	94 950	0,01
Romania 4.15% 20 - 26.01.28	150 000	RON	28 451	30 958	0,01
Romania 4.15% 20 - 24.10.30	220 000	RON	44 641	43 343	0,01
Romania 4.25% 21 - 28.04.36	150 000	RON	22 197	27 506	0,00
Romania 4.625% 19 - 03.04.49	25 000	EUR	26 529	23 181	0,00
Romania 4.75% 19 - 11.10.34	220 000	RON	39 645	42 996	0,01
Romania 4.85% 18 - 22.04.26	450 000	RON	97 833	97 363	0,02
Romania 4.85% 21 - 25.07.29	280 000	RON	53 717	58 127	0,01
Romania 5.00% 18 - 12.02.29	200 000	RON	43 131	42 021	0,01
Romania 5.80% 12 - 26.07.27	200 000	RON	38 660	43 888	0,01
Romania 7.35% 23 - 28.04.31	250 000	RON	56 870	58 729	0,01
Romania 7.90% 23 - 24.02.38	100 000	RON	24 904	25 583	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Romania 8.00% 23 - 29.04.30	100 000	RON	23 978	24 134	0,00
Romania 8.25% 22 - 29.09.32	200 000	RON	43 698	50 141	0,01
Romania 8.75% 22 - 30.10.28	100 000	RON	23 091	24 476	0,00
			1 684 278	1 684 371	0,25
Singapour					
Flex Ltd. 4.875% 19 - 15.06.29	50 000	USD	51 500	49 162	0,01
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd. 4.65% 23 - 19.05.25	50 000	USD	49 701	49 875	0,01
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd. 5.11% 23 - 19.05.43	50 000	USD	48 180	49 968	0,01
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd. 5.30% 23 - 19.05.53	150 000	USD	154 115	153 743	0,02
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd. 5.34% 23 - 19.05.63	200 000	USD	200 351	202 574	0,03
Singapore Zero Coupon 21 - 01.07.31	90 000	SGD	63 292	63 171	0,01
Singapore Zero Coupon 21 - 01.11.26	150 000	SGD	103 985	108 539	0,02
Singapore 0.50% 20 - 01.11.25	100 000	SGD	71 565	72 104	0,01
Singapore 1.875% 20 - 01.03.50	180 000	SGD	117 070	114 633	0,02
Singapore 1.875% 21 - 01.10.51	40 000	SGD	27 388	25 425	0,00
Singapore 2.125% 16 - 01.06.26	134 000	SGD	98 886	99 350	0,01
Singapore 2.25% 16 - 01.08.36	131 000	SGD	91 000	94 229	0,01
Singapore 2.375% 15 - 01.06.25	41 000	SGD	30 379	30 618	0,00
Singapore 2.375% 19 - 01.07.39	70 000	SGD	49 985	50 466	0,01
Singapore 2.625% 18 - 01.05.28	70 000	SGD	50 115	52 973	0,01
Singapore 2.625% 22 - 01.08.32	110 000	SGD	79 273	82 781	0,01
Singapore 2.75% 12 - 01.04.42	102 000	SGD	77 368	77 223	0,01
Singapore 2.75% 16 - 01.03.46	117 000	SGD	87 872	88 396	0,01
Singapore 2.875% 10 - 01.09.30	100 000	SGD	75 066	76 406	0,01
Singapore 2.875% 14 - 01.07.29	140 000	SGD	106 299	106 897	0,02
Singapore 2.875% 22 - 01.09.27	100 000	SGD	74 428	76 216	0,01
Singapore 2.875% 23 - 01.08.28	120 000	SGD	88 859	91 759	0,01
Singapore 3.00% 22 - 01.08.72	105 000	SGD	79 534	85 202	0,01
Singapore 3.375% 13 - 01.09.33	147 000	SGD	114 780	117 766	0,02
Singapore 3.50% 07 - 01.03.27	131 000	SGD	100 383	101 135	0,02
Temasek Financial I Ltd. 144A 1.625% 21 - 02.08.31	200 000	USD	174 735	165 100	0,02
Temasek Financial I Ltd. 144A 3.375% 12 - 23.07.42	200 000	USD	209 695	179 086	0,03
			2 475 804	2 464 797	0,36
Slovaquie					
Slovakia 0.375% 21 - 21.04.36	80 000	EUR	75 187	61 058	0,01
Slovakia 1.00% 18 - 12.06.28	65 000	EUR	72 349	66 571	0,01
Slovakia 1.00% 20 - 09.10.30	100 000	EUR	100 491	97 176	0,01
Slovakia 1.00% 20 - 14.05.32	45 000	EUR	48 744	42 120	0,01
Slovakia 1.375% 15 - 21.01.27	32 000	EUR	36 251	33 915	0,00
Slovakia 2.00% 17 - 17.10.47	50 000	EUR	56 712	40 937	0,01
Slovakia 3.625% 14 - 16.01.29	80 000	EUR	94 570	91 717	0,01
Slovakia 3.75% 23 - 23.02.35	100 000	EUR	108 409	113 902	0,02
Slovakia 4.00% 22 - 19.10.32	100 000	EUR	112 207	117 821	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Slovaquie (suite)					
Slovenska Sporitelna AS 3.50% 22 - 05.04.28	100 000	EUR	105 917	112 475	0,02
Vseobecna Uverova Banka AS 0.01% 21 - 24.03.26	100 000	EUR	107 895	102 938	0,01
			918 732	880 630	0,13
Slovénie					
Slovenia 0.125% 21 - 01.07.31	40 000	EUR	40 683	36 416	0,01
Slovenia 0.488% 20 - 20.10.50	35 000	EUR	28 714	20 182	0,00
Slovenia 0.875% 20 - 15.07.30	25 000	EUR	27 003	24 552	0,00
Slovenia 1.25% 17 - 22.03.27	33 000	EUR	37 209	34 827	0,00
Slovenia 1.50% 15 - 25.03.35	60 000	EUR	65 418	56 020	0,01
Slovenia 1.75% 16 - 03.11.40	60 000	EUR	66 844	53 901	0,01
Slovenia 2.125% 15 - 28.07.25	100 000	EUR	113 842	109 220	0,02
Slovenia 3.125% 15 - 07.08.45	50 000	EUR	49 588	54 921	0,01
Slovenia 3.625% 23 - 11.03.33	13 000	EUR	14 238	15 208	0,00
			443 539	405 247	0,06
Espagne					
Abertis Infraestructuras SA 1.125% 19 - 26.03.28	100 000	EUR	91 337	101 190	0,01
Abertis Infraestructuras SA 2.50% 14 - 27.02.25	100 000	EUR	107 124	108 946	0,02
Amadeus IT Group SA 1.875% 20 - 24.09.28	100 000	EUR	110 820	105 377	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 15.11.26	200 000	EUR	214 437	204 592	0,03
Banco de Sabadell SA FRN 20 - 11.03.27	100 000	EUR	108 279	104 837	0,01
Banco Santander SA 0.30% 19 - 04.10.26	100 000	EUR	99 085	102 628	0,01
Banco Santander SA 1.125% 18 - 17.01.25	100 000	EUR	110 232	107 478	0,02
Banco Santander SA 2.00% 14 - 27.11.34	100 000	EUR	117 758	99 553	0,01
Banco Santander SA 2.125% 18 - 08.02.28	100 000	EUR	109 927	104 541	0,01
Banco Santander SA 2.746% 20 - 28.05.25	200 000	USD	194 526	193 064	0,03
Banco Santander SA 3.80% 17 - 23.02.28	100 000	USD	96 176	94 469	0,01
Banco Santander SA 3.875% 06 - 06.02.26	100 000	EUR	117 341	112 373	0,02
Banco Santander SA 4.25% 17 - 11.04.27	200 000	USD	192 405	193 862	0,03
Banco Santander SA 4.625% 07 - 04.05.27	100 000	EUR	123 718	116 798	0,02
Banco Santander SA FRN 22 - 30.08.28	100 000	GBP	119 604	126 862	0,02
Bankinter SA 0.625% 20 - 06.10.27	100 000	EUR	104 741	100 541	0,01
Bankinter SA FRN 23 - 03.05.30	100 000	EUR	110 889	114 569	0,02
CaixaBank SA 0.375% 20 - 03.02.25	100 000	EUR	109 264	106 656	0,02
CaixaBank SA FRN 21 - 09.02.29	100 000	EUR	94 196	97 367	0,01
CaixaBank SA 1.00% 18 - 17.01.28	100 000	EUR	110 161	102 725	0,01
CaixaBank SA 1.375% 19 - 19.06.26	100 000	EUR	109 263	104 906	0,01
CaixaBank SA 3.875% 05 - 17.02.25	100 000	EUR	114 261	110 859	0,02
CaixaBank SA 4.375% 23 - 29.11.33	100 000	EUR	109 930	116 078	0,02
Deutsche Bank SA Espanola 3.625% 23 - 23.11.26	100 000	EUR	109 650	112 456	0,02
Enagas Financiaciones SA 1.375% 16 - 05.05.28	100 000	EUR	98 573	104 664	0,01
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.625% 17 - 28.11.25	100 000	EUR	104 048	106 812	0,02
Instituto de Credito Oficial Zero Coupon 21 - 30.04.27	100 000	EUR	107 210	101 026	0,01
Instituto de Credito Oficial 3.80% 23 - 31.05.29	13 000	EUR	13 890	15 087	0,00
Mapfre SA 1.625% 16 - 19.05.26	100 000	EUR	111 186	108 065	0,02
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 16 - 02.11.26	100 000	EUR	110 201	106 337	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Programa Cédulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos 4.25% 06 - 10.04.31	100 000	EUR	104 485	120 041	0,02
Santander Consumer Finance SA 0.50% 22 - 14.01.27	100 000	EUR	96 912	101 616	0,01
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	230 000	EUR	252 499	245 919	0,04
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	200 000	EUR	217 666	209 165	0,03
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	340 000	EUR	325 991	339 322	0,05
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.27	329 000	EUR	315 457	336 413	0,05
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	200 000	EUR	208 607	212 024	0,03
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	300 000	EUR	289 610	300 565	0,04
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	301 000	EUR	324 018	333 876	0,05
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	299 000	EUR	422 357	403 209	0,06
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	281 000	EUR	379 045	360 804	0,05
Spain 144A 0.10% 21 - 30.04.31	290 000	EUR	254 404	264 906	0,04
Spain 144A 0.50% 20 - 30.04.30	258 000	EUR	242 798	249 617	0,04
Spain 144A 0.50% 21 - 31.10.31	200 000	EUR	186 524	185 826	0,03
Spain 144A 0.60% 19 - 31.10.29	220 000	EUR	236 656	216 869	0,03
Spain 144A 0.70% 22 - 30.04.32	300 000	EUR	286 077	279 654	0,04
Spain 144A 0.80% 20 - 30.07.27	240 000	EUR	223 077	249 649	0,04
Spain 144A 0.85% 21 - 30.07.37	126 000	EUR	124 281	102 644	0,01
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	292 000	EUR	222 722	181 823	0,03
Spain 144A 1.00% 21 - 30.07.42	60 000	EUR	57 871	44 368	0,01
Spain 144A 1.20% 20 - 31.10.40	198 000	EUR	199 152	156 985	0,02
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	280 000	EUR	310 394	281 487	0,04
Spain 144A 1.30% 16 - 31.10.26	310 000	EUR	348 154	331 031	0,05
Spain 144A 1.40% 18 - 30.04.28	400 000	EUR	440 360	421 702	0,06
Spain 144A 1.40% 18 - 30.07.28	250 000	EUR	258 414	262 840	0,04
Spain 144A 1.45% 17 - 31.10.27	250 000	EUR	282 096	265 530	0,04
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	280 000	EUR	288 441	292 263	0,04
Spain 144A 1.45% 21 - 31.10.71	70 000	EUR	56 903	39 077	0,01
Spain 144A 1.50% 17 - 30.04.27	350 000	EUR	383 857	374 066	0,05
Spain 144A 1.60% 15 - 30.04.25	300 000	EUR	336 305	325 559	0,05
Spain 144A 1.85% 19 - 30.07.35	239 000	EUR	270 826	232 143	0,03
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	190 000	EUR	146 402	145 330	0,02
Spain 144A 1.95% 15 - 30.07.30	380 000	EUR	405 085	401 562	0,06
Spain 144A 1.95% 16 - 30.04.26	200 000	EUR	206 300	217 629	0,03
Spain 144A 2.15% 15 - 31.10.25	310 000	EUR	340 589	339 158	0,05
Spain 144A 2.35% 17 - 30.07.33	209 000	EUR	249 112	219 557	0,03
Spain 144A 2.55% 22 - 31.10.32	230 000	EUR	233 963	247 728	0,04
Spain 144A 2.70% 18 - 31.10.48	200 000	EUR	243 048	190 188	0,03
Spain 144A 2.90% 16 - 31.10.46	180 000	EUR	217 498	179 838	0,03
Spain 144A 3.15% 23 - 30.04.33	339 000	EUR	364 186	380 715	0,06
Spain 144A 3.45% 16 - 30.07.66	205 000	EUR	246 002	212 334	0,03
Spain 144A 3.45% 22 - 30.07.43	160 000	EUR	165 158	175 231	0,03
Spain 144A 3.50% 23 - 31.05.29	109 000	EUR	115 521	125 769	0,02
Spain 144A 3.55% 23 - 31.10.33	350 000	EUR	395 915	404 927	0,06
Spain 144A 3.90% 23 - 30.07.39	130 000	EUR	138 267	152 205	0,02
Spain 144A 4.20% 05 - 31.01.37	320 000	EUR	384 626	391 191	0,06
Spain 144A 4.65% 10 - 30.07.25	250 000	EUR	281 811	283 682	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 4.70% 09 - 30.07.41	297 000	EUR	449 709	384 032	0,06
Spain 144A 4.90% 07 - 30.07.40	252 000	EUR	333 839	329 965	0,05
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.28	207 000	EUR	273 702	255 533	0,04
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.44	220 000	EUR	360 690	302 632	0,04
Spain 144A 5.90% 11 - 30.07.26	280 000	EUR	334 878	334 257	0,05
Telefonica Emisiones SA 1.715% 17 - 12.01.28	100 000	EUR	97 516	104 493	0,01
Telefonica Emisiones SA 1.93% 16 - 17.10.31	100 000	EUR	111 692	100 892	0,01
Telefonica Emisiones SA 4.103% 17 - 08.03.27	30 000	USD	30 423	29 409	0,00
Telefonica Emisiones SA 4.665% 18 - 06.03.38	20 000	USD	20 079	18 386	0,00
Telefonica Emisiones SA 5.52% 19 - 01.03.49	60 000	USD	65 940	58 106	0,01
Telefonica Emisiones SA 7.045% 06 - 20.06.36	50 000	USD	60 780	56 651	0,01
			17 648 922	17 147 111	2,51
Supranationales					
Asian Development Bank 0.10% 21 - 17.06.31	100 000	EUR	88 882	92 402	0,01
Asian Development Bank 0.25% 20 - 28.10.27	70 000	GBP	86 898	78 237	0,01
Asian Development Bank 0.80% 21 - 06.11.25	200 000	AUD	132 002	128 239	0,02
Asian Development Bank 1.00% 21 - 14.04.26	200 000	USD	192 064	186 060	0,03
Asian Development Bank 1.50% 21 - 04.03.31	200 000	USD	187 609	169 130	0,02
Asian Development Bank 1.875% 20 - 24.01.30	100 000	USD	87 161	88 463	0,01
Asian Development Bank 2.75% 22 - 28.01.27	200 000	NZD	135 567	120 103	0,02
Asian Development Bank 3.125% 22 - 20.08.27	180 000	USD	177 469	174 454	0,03
Asian Development Bank 4.00% 23 - 12.01.33	100 000	USD	96 362	99 808	0,01
Council Of Europe Development Bank 0.375% 18 - 27.03.25	100 000	EUR	109 929	106 861	0,02
Council Of Europe Development Bank 2.875% 23 - 13.04.30	100 000	EUR	109 807	113 030	0,02
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0.10% 20 - 20.05.30	100 000	EUR	103 640	94 719	0,01
European Bank for Reconstruction & Development 0.50% 20 - 19.05.25	200 000	USD	190 469	188 992	0,03
European Bank for Reconstruction & Development 1.50% 20 - 13.02.25	200 000	USD	196 898	192 988	0,03
European Investment Bank Zero Coupon 20 - 25.03.25	300 000	EUR	327 928	319 800	0,05
European Investment Bank Zero Coupon 20 - 17.06.27	240 000	EUR	258 514	244 421	0,04
European Investment Bank Zero Coupon 20 - 28.03.28	140 000	EUR	149 638	139 959	0,02
European Investment Bank Zero Coupon 21 - 14.01.31	120 000	EUR	124 012	111 485	0,02
European Investment Bank Zero Coupon 21 - 28.09.28	100 000	EUR	99 487	98 860	0,01
European Investment Bank 0.01% 20 - 15.11.35	120 000	EUR	115 237	96 191	0,01
European Investment Bank 0.01% 21 - 15.05.41	60 000	EUR	54 103	40 311	0,01
European Investment Bank 0.05% 19 - 13.10.34	100 000	EUR	78 871	83 408	0,01
European Investment Bank 0.05% 20 - 16.01.30	100 000	EUR	92 497	96 022	0,01
European Investment Bank 0.05% 21 - 27.01.51	50 000	EUR	30 684	25 308	0,00
European Investment Bank 0.125% 19 - 20.06.29	120 000	EUR	127 288	117 346	0,02
European Investment Bank 0.25% 20 - 15.06.40	100 000	EUR	94 575	72 432	0,01
European Investment Bank 0.25% 22 - 20.01.32	100 000	EUR	104 023	92 474	0,01
European Investment Bank 0.375% 16 - 14.04.26	150 000	EUR	164 585	158 084	0,02
European Investment Bank 0.375% 21 - 26.03.26	400 000	USD	382 330	367 724	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Supranationales (suite)					
European Investment Bank 1.00% 16 - 14.04.32	90 000	EUR	99 187	88 215	0,01
European Investment Bank 1.00% 16 - 21.09.26	30 000	GBP	38 743	35 436	0,00
European Investment Bank 1.125% 16 - 15.09.36	40 000	EUR	43 585	36 447	0,01
European Investment Bank 1.125% 17 - 13.04.33	100 000	EUR	96 089	97 246	0,01
European Investment Bank 1.125% 22 - 19.06.25	100 000	GBP	130 662	121 418	0,02
European Investment Bank 1.30% 21 - 27.01.31	150 000	AUD	97 735	82 385	0,01
European Investment Bank 1.50% 22 - 15.06.32	120 000	EUR	115 667	122 173	0,02
European Investment Bank 1.625% 20 - 14.03.25	200 000	USD	197 401	193 012	0,03
European Investment Bank 1.75% 14 - 15.09.45	60 000	EUR	72 794	53 667	0,01
European Investment Bank 1.875% 15 - 10.02.25	200 000	USD	193 324	193 992	0,03
European Investment Bank 1.90% 20 - 22.01.25	150 000	CAD	119 130	110 499	0,02
European Investment Bank 2.75% 12 - 15.09.25	120 000	EUR	137 388	132 801	0,02
European Investment Bank 2.75% 22 - 15.08.25	200 000	USD	193 545	194 678	0,03
European Investment Bank 2.75% 23 - 30.07.30	100 000	EUR	107 277	112 298	0,02
European Investment Bank 2.875% 23 - 12.01.33	100 000	EUR	109 088	112 888	0,02
European Investment Bank 3.00% 13 - 14.10.33	100 000	EUR	129 263	114 037	0,02
European Investment Bank 3.00% 23 - 15.07.33	50 000	EUR	53 246	56 970	0,01
European Investment Bank 3.25% 22 - 15.11.27	100 000	USD	95 960	97 303	0,01
European Investment Bank 3.625% 23 - 15.07.30	100 000	USD	97 299	97 998	0,01
European Investment Bank 3.75% 23 - 14.02.33	200 000	USD	195 137	196 544	0,03
European Investment Bank 3.875% 23 - 15.03.28	150 000	USD	151 001	149 487	0,02
European Investment Bank 4.00% 10 - 15.04.30	100 000	EUR	131 596	120 449	0,02
European Investment Bank 4.50% 07 - 07.03.44	50 000	GBP	64 572	65 600	0,01
European Investment Bank 4.50% 09 - 15.10.25	100 000	EUR	110 699	114 012	0,02
European Investment Bank 4.50% 23 - 16.10.28	150 000	USD	153 073	153 487	0,02
European Investment Bank 4.625% 04 - 12.10.54	15 000	GBP	30 753	20 216	0,00
European Investment Bank 5.00% 99 - 15.04.39	30 000	GBP	54 684	41 988	0,01
European Investment Bank 5.625% 00 - 07.06.32	50 000	GBP	84 759	72 682	0,01
European Investment Bank 6.00% 98 - 07.12.28	50 000	GBP	79 067	70 322	0,01
European Stability Mechanism Zero Coupon 19 - 14.03.25	67 000	EUR	73 382	71 478	0,01
European Stability Mechanism 0.50% 16 - 02.03.26	105 000	EUR	115 488	111 141	0,02
European Stability Mechanism 0.50% 19 - 05.03.29	58 000	EUR	62 784	58 156	0,01
European Stability Mechanism 0.75% 18 - 05.09.28	92 000	EUR	101 171	94 209	0,01
European Stability Mechanism 0.875% 16 - 18.07.42	32 000	EUR	33 485	24 527	0,00
European Stability Mechanism 1.00% 15 - 23.09.25	50 000	EUR	55 524	53 694	0,01
European Stability Mechanism 1.125% 16 - 03.05.32	75 000	EUR	83 308	74 040	0,01
European Stability Mechanism 1.625% 15 - 17.11.36	47 000	EUR	54 336	45 235	0,01
European Stability Mechanism 1.75% 15 - 20.10.45	39 000	EUR	47 679	34 652	0,00
European Stability Mechanism 1.80% 17 - 02.11.46	64 000	EUR	78 954	57 293	0,01
European Stability Mechanism 1.85% 15 - 01.12.55	52 000	EUR	67 545	42 896	0,01
European Stability Mechanism 3.00% 23 - 15.03.28	150 000	EUR	162 456	169 741	0,02
European Stability Mechanism 3.00% 23 - 23.08.33	50 000	EUR	54 219	57 088	0,01
European Union Zero Coupon 20 - 04.10.30	82 000	EUR	85 083	76 962	0,01
European Union Zero Coupon 20 - 04.11.25	105 000	EUR	114 750	110 831	0,02
European Union Zero Coupon 20 - 04.07.35	180 000	EUR	173 439	145 054	0,02
European Union Zero Coupon 21 - 02.06.28	150 000	EUR	149 960	149 575	0,02
European Union Zero Coupon 21 - 04.03.26	100 000	EUR	108 666	105 024	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Supranationales (suite)					
European Union Zero Coupon 21 - 04.07.29	120 000	EUR	126 446	116 304	0,02
European Union Zero Coupon 21 - 04.07.31	180 000	EUR	184 361	164 915	0,02
European Union Zero Coupon 21 - 06.07.26	350 000	EUR	380 712	363 538	0,05
European Union Zero Coupon 21 - 22.04.31	50 000	EUR	46 922	46 171	0,01
European Union Zero Coupon 21 - 04.10.28	252 000	EUR	257 209	248 464	0,04
European Union 0.10% 20 - 04.10.40	110 000	EUR	100 475	76 511	0,01
European Union 0.20% 21 - 04.06.36	150 000	EUR	146 729	120 681	0,02
European Union 0.25% 21 - 22.04.36	150 000	EUR	116 273	122 076	0,02
European Union 0.30% 20 - 04.11.50	129 000	EUR	112 220	73 038	0,01
European Union 0.40% 21 - 04.02.37	120 000	EUR	119 946	98 126	0,01
European Union 0.45% 21 - 02.05.46	64 000	EUR	60 102	41 889	0,01
European Union 0.45% 21 - 04.07.41	150 000	EUR	135 546	108 694	0,02
European Union 0.50% 18 - 04.04.25	30 000	EUR	33 101	32 196	0,00
European Union 0.70% 21 - 06.07.51	180 000	EUR	152 884	113 399	0,02
European Union 0.75% 21 - 04.01.47	77 000	EUR	76 862	53 850	0,01
European Union 0.80% 22 - 04.07.25	250 000	EUR	260 956	267 944	0,04
European Union 1.00% 22 - 06.07.32	100 000	EUR	93 228	97 264	0,01
European Union 1.125% 22 - 04.06.37	50 000	EUR	39 012	44 461	0,01
European Union 1.25% 18 - 04.04.33	100 000	EUR	92 933	98 397	0,01
European Union 1.25% 22 - 04.02.43	100 000	EUR	91 259	82 782	0,01
European Union 1.375% 14 - 04.10.29	150 000	EUR	149 154	156 201	0,02
European Union 1.625% 22 - 04.12.29	200 000	EUR	200 121	210 869	0,03
European Union 2.00% 22 - 04.10.27	200 000	EUR	197 957	217 676	0,03
European Union 2.50% 22 - 04.10.52	80 000	EUR	72 999	78 533	0,01
European Union 2.625% 22 - 04.02.48	140 000	EUR	142 410	144 064	0,02
European Union 2.75% 22 - 04.02.33	100 000	EUR	103 531	111 908	0,02
European Union 2.75% 22 - 04.12.37	100 000	EUR	99 747	108 467	0,02
European Union 2.75% 23 - 05.10.26	100 000	EUR	107 630	111 319	0,02
European Union 2.875% 12 - 04.04.28	100 000	EUR	99 623	112 623	0,02
European Union 3.00% 22 - 04.03.53	200 000	EUR	208 686	216 938	0,03
European Union 3.125% 23 - 04.12.30	150 000	EUR	173 685	171 921	0,02
European Union 3.25% 23 - 04.07.34	200 000	EUR	220 128	231 550	0,03
European Union 3.375% 12 - 04.04.32	150 000	EUR	166 781	175 752	0,03
European Union 3.375% 22 - 04.11.42	190 000	EUR	197 683	219 047	0,03
European Union 3.375% 23 - 04.10.38	100 000	EUR	109 734	116 077	0,02
European Union 3.75% 12 - 04.04.42	100 000	EUR	115 682	121 351	0,02
European Union 4.00% 23 - 04.04.44	100 000	EUR	106 311	125 255	0,02
Inter-American Development Bank 0.50% 19 - 15.09.26	50 000	GBP	63 734	58 124	0,01
Inter-American Development Bank 0.625% 20 - 15.07.25	200 000	USD	191 043	188 508	0,03
Inter-American Development Bank 0.875% 21 - 20.04.26	400 000	USD	386 003	371 044	0,05
Inter-American Development Bank 1.125% 21 - 13.01.31	200 000	USD	183 000	165 244	0,02
Inter-American Development Bank 1.125% 21 - 20.07.28	250 000	USD	235 667	220 367	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Supranationales (suite)					
Inter-American Development Bank 1.75% 20 - 14.03.25	200 000	USD	194 361	193 186	0,03
Inter-American Development Bank 2.00% 19 - 23.07.26	100 000	USD	93 868	94 725	0,01
Inter-American Development Bank 3.20% 12 - 07.08.42	100 000	USD	92 956	84 061	0,01
Inter-American Development Bank 3.40% 23 - 24.05.28	50 000	CAD	34 485	37 692	0,01
Inter-American Development Bank 4.00% 23 - 12.01.28	360 000	USD	364 373	359 719	0,05
Inter-American Development Bank 4.25% 14 - 11.06.26	100 000	AUD	68 221	68 389	0,01
International Bank for Reconstruction & Development Zero Coupon 20 - 21.02.30	80 000	EUR	83 119	76 068	0,01
International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 20 - 24.04.28	100 000	EUR	105 857	99 671	0,01
International Bank for Reconstruction & Development 0.125% 20 - 03.01.51	40 000	EUR	32 714	21 113	0,00
International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21 - 21.01.61	40 000	EUR	31 188	16 883	0,00
International Bank for Reconstruction & Development 0.50% 20 - 28.10.25	80 000	USD	75 013	74 578	0,01
International Bank for Reconstruction & Development 0.625% 20 - 22.04.25	400 000	USD	382 234	380 088	0,06
International Bank for Reconstruction & Development 0.625% 21 - 14.01.26	150 000	CAD	115 179	106 191	0,02
International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 20 - 15.12.26	30 000	GBP	38 322	34 966	0,00
International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 20 - 26.08.30	400 000	USD	359 634	324 224	0,05
International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 20 - 24.11.27	200 000	USD	182 140	176 510	0,03
International Bank for Reconstruction & Development 0.875% 21 - 15.07.26	400 000	USD	385 344	368 632	0,05
International Bank for Reconstruction & Development 1.00% 20 - 21.12.29	30 000	GBP	37 694	32 913	0,00
International Bank for Reconstruction & Development 1.10% 20 - 18.11.30	78 000	AUD	44 098	42 649	0,01
International Bank for Reconstruction & Development 1.125% 21 - 13.09.28	350 000	USD	329 217	307 429	0,04
International Bank for Reconstruction & Development 1.375% 21 - 20.04.28	200 000	USD	187 367	179 474	0,03
International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 20 - 15.01.25	40 000	USD	39 499	38 744	0,01
International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 21 - 03.11.31	150 000	USD	136 766	126 582	0,02
International Bank for Reconstruction & Development 2.50% 15 - 29.07.25	100 000	USD	96 462	96 990	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Supranationales (suite)					
International Bank for Reconstruction & Development 2.90% 23 - 19.01.33	100 000	EUR	107 072	113 092	0,02
International Bank for Reconstruction & Development 3.10% 23 - 14.04.38	100 000	EUR	108 423	113 555	0,02
International Bank for Reconstruction & Development 3.50% 23 - 12.07.28	70 000	USD	67 675	68 608	0,01
International Bank for Reconstruction & Development 3.875% 23 - 14.02.30	140 000	USD	141 158	139 097	0,02
International Bank for Reconstruction & Development 5.75% 00 - 07.06.32	20 000	GBP	34 064	29 071	0,00
International Finance Corp. 0.75% 20 - 22.07.27	50 000	GBP	63 544	57 147	0,01
International Finance Corp. 1.85% 22 - 28.01.27	50 000	CAD	33 188	35 883	0,00
International Finance Corp. 3.20% 16 - 22.07.26	200 000	AUD	151 145	133 343	0,02
			19 278 347	18 471 968	2,70
Suède					
Danske Hypotek AB 1.00% 20 - 17.12.25	2 000 000	SEK	209 888	190 584	0,03
Investor AB 0.375% 20 - 29.10.35	100 000	EUR	92 595	80 016	0,01
Kommuninvest I Sverige AB 0.25% 20 - 26.11.27	400 000	SEK	39 440	36 062	0,01
Kommuninvest I Sverige AB 0.50% 21 - 15.06.27	800 000	SEK	71 800	73 640	0,01
Kommuninvest I Sverige AB 0.75% 20 - 04.02.26	900 000	SEK	94 045	85 381	0,01
Kommuninvest I Sverige AB 1.00% 18 - 12.05.25	1 000 000	SEK	105 789	96 281	0,01
Kommuninvest I Sverige AB 3.25% 23 - 12.11.29	1 000 000	SEK	90 112	101 930	0,01
Lansforsakringar Hypotek AB 0.50% 21 - 20.09.28	400 000	SEK	33 350	35 552	0,01
Lansforsakringar Hypotek AB 1.00% 20 - 15.09.27	500 000	SEK	45 287	46 436	0,01
Lansforsakringar Hypotek AB 1.50% 19 - 16.09.26	400 000	SEK	42 194	38 261	0,01
Nordea Bank Abp FRN 21 - 18.08.31	100 000	EUR	104 795	101 526	0,01
Nordea Hypotek AB 0.50% 20 - 16.09.26	200 000	SEK	20 511	18 625	0,00
Nordea Hypotek AB 3.375% 22 - 25.11.27	2 000 000	SEK	186 782	202 077	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.50% 21 - 16.12.26	2 000 000	SEK	166 094	185 228	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.75% 22 - 28.06.27	100 000	EUR	99 780	103 139	0,02
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.00% 23 - 06.11.28	2 000 000	SEK	187 685	199 372	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.00% 22 - 09.11.26	100 000	EUR	107 915	112 396	0,02
Stadshypotek AB 0.50% 20 - 01.06.26	2 000 000	SEK	206 307	187 403	0,03
Stadshypotek AB 1.00% 20 - 03.09.25	2 000 000	SEK	210 597	191 481	0,03
Stadshypotek AB 1.00% 21 - 01.03.27	2 000 000	SEK	192 261	187 473	0,03
Stadshypotek AB 2.00% 18 - 01.09.28	1 000 000	SEK	106 184	95 442	0,01
Svensk Exportkredit AB 0.50% 20 - 26.08.25	100 000	USD	96 841	93 488	0,01
Svenska Handelsbanken AB 0.50% 20 - 18.02.30	100 000	EUR	101 876	93 544	0,01
Sveriges Sakerställda Obligationer AB 0.01% 21 - 14.03.30	100 000	EUR	87 576	92 932	0,01
Sveriges Sakerställda Obligationer AB 2.00% 17 - 17.06.26	1 000 000	SEK	99 731	97 062	0,01
Swedbank AB FRN 21 - 20.05.27	100 000	EUR	106 322	102 050	0,01
Swedbank Hypotek AB 1.00% 20 - 18.03.26	1 400 000	SEK	137 365	133 091	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Swedbank Hypotek AB 1.00% 21 - 17.03.27	500 000	SEK	47 904	46 823	0,01
Swedbank Hypotek AB 3.00% 22 - 15.03.28	500 000	SEK	47 374	49 893	0,01
Sweden 0.125% 20 - 12.05.31	1 000 000	SEK	85 309	86 840	0,01
Sweden 0.125% 20 - 09.09.30	1 000 000	SEK	83 790	87 888	0,01
Sweden 0.50% 20 - 24.11.45	400 000	SEK	35 727	27 858	0,00
Sweden 0.75% 17 - 12.05.28	2 085 000	SEK	189 715	195 767	0,03
Sweden 0.75% 18 - 12.11.29	1 300 000	SEK	120 122	120 216	0,02
Sweden 1.00% 15 - 12.11.26	1 400 000	SEK	135 169	134 104	0,02
Sweden 1.375% 21 - 23.06.71	300 000	SEK	17 659	20 249	0,00
Sweden 1.75% 22 - 11.11.33	300 000	SEK	30 122	29 006	0,00
Sweden 2.25% 12 - 01.06.32	650 000	SEK	68 303	65 761	0,01
Sweden 2.50% 14 - 12.05.25	725 000	SEK	79 059	71 567	0,01
Sweden 3.50% 09 - 30.03.39	490 000	SEK	62 405	56 705	0,01
Telia Co. AB 3.625% 23 - 22.02.32	100 000	EUR	109 179	114 345	0,02
Volvo Treasury AB 1.625% 22 - 18.09.25	100 000	EUR	106 983	107 336	0,02
			4 261 942	4 194 830	0,61
Suisse					
Basler Kantonalbank 0.30% 17 - 22.06.27	60 000	CHF	59 266	68 522	0,01
Credit Suisse AG 0.25% 21 - 01.09.28	100 000	EUR	89 735	96 068	0,01
Credit Suisse AG 2.95% 20 - 09.04.25	100 000	USD	99 609	96 890	0,01
Credit Suisse AG 7.50% 23 - 15.02.28	50 000	USD	52 088	54 844	0,01
Nestle SA 0.75% 18 - 28.06.28	60 000	CHF	64 728	69 656	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG Zero Coupon 19 - 15.06.27	60 000	CHF	63 421	68 068	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0.125% 17 - 06.05.25	60 000	CHF	64 378	69 954	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0.125% 20 - 07.06.28	60 000	CHF	63 126	67 583	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0.125% 21 - 19.03.31	50 000	CHF	51 012	54 252	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0.25% 16 - 05.08.26	50 000	CHF	53 505	57 721	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0.25% 18 - 17.11.25	60 000	CHF	64 487	69 720	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0.25% 20 - 15.03.41	60 000	CHF	50 995	58 974	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0.875% 15 - 07.05.35	50 000	CHF	52 729	55 840	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0.875% 15 - 25.06.37	50 000	CHF	52 237	55 396	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 1.375% 12 - 20.09.29	50 000	CHF	55 688	59 468	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 1.50% 12 - 02.08.33	50 000	CHF	56 269	59 816	0,01
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 1.875% 10 - 15.09.31	150 000	CHF	169 931	184 363	0,03
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 1.875% 23 - 14.01.33	50 000	CHF	54 740	61 690	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 2.25% 10 - 13.08.32	50 000	CHF	59 627	63 408	0,01
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG Zero Coupon 20 - 19.07.30	50 000	CHF	51 009	54 311	0,01
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.10% 19 - 03.12.31	40 000	CHF	40 440	42 896	0,00
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.25% 17 - 12.05.26	60 000	CHF	64 380	69 420	0,01
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.30% 16 - 06.06.31	40 000	CHF	41 251	43 858	0,01
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.30% 19 - 09.04.29	100 000	CHF	105 305	112 542	0,02
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.375% 15 - 15.09.25	60 000	CHF	64 589	69 988	0,01
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.375% 17 - 21.09.27	120 000	CHF	128 313	137 597	0,02
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.60% 16 - 11.12.35	60 000	CHF	61 405	64 689	0,01
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.75% 18 - 01.10.32	60 000	CHF	63 513	67 384	0,01
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 1.00% 14 - 22.09.28	50 000	CHF	54 633	58 471	0,01
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 1.45% 22 - 14.03.42	20 000	CHF	19 418	24 146	0,00
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 1.625% 12 - 17.04.28	100 000	CHF	112 157	120 197	0,02
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 1.70% 22 - 27.07.32	100 000	CHF	115 440	121 568	0,02
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 4.84% 23 - 03.11.28	100 000	EUR	111 293	115 221	0,02
Switzerland Zero Coupon 16 - 22.06.29	100 000	CHF	98 623	114 177	0,02
Switzerland Zero Coupon 19 - 26.06.34	50 000	CHF	48 043	55 252	0,01
Switzerland Zero Coupon 19 - 24.07.39	30 000	CHF	27 813	32 156	0,00
Switzerland 0.25% 21 - 23.06.35	60 000	CHF	62 364	67 847	0,01
Switzerland 0.50% 15 - 27.05.30	50 000	CHF	57 343	58 627	0,01
Switzerland 0.50% 17 - 28.06.45	100 000	CHF	107 327	115 592	0,02
Switzerland 0.50% 18 - 27.06.32	60 000	CHF	60 324	70 012	0,01
Switzerland 1.25% 12 - 27.06.37	130 000	CHF	150 872	165 935	0,02
Switzerland 1.25% 14 - 28.05.26	50 000	CHF	55 297	59 806	0,01
Switzerland 1.25% 23 - 28.06.43	70 000	CHF	81 989	92 358	0,01
Switzerland 1.50% 12 - 30.04.42	50 000	CHF	60 129	68 039	0,01
Switzerland 1.50% 22 - 26.10.38	50 000	CHF	55 183	66 352	0,01
Switzerland 2.00% 14 - 25.06.64	105 000	CHF	169 976	196 298	0,03
Switzerland 2.25% 11 - 22.06.31	70 000	CHF	84 997	92 500	0,01
Switzerland 3.25% 07 - 27.06.27	50 000	CHF	57 355	64 289	0,01
Switzerland 4.00% 98 - 08.04.28	81 000	CHF	98 638	109 122	0,01
UBS AG 0.01% 21 - 31.03.26	200 000	EUR	214 320	205 792	0,03
UBS AG 1.25% 23 - 01.06.26	15 000	USD	14 318	13 776	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.50% 23 - 26.06.48	25 000	USD	26 981	24 720	0,00
UBS Group AG 0.625% 21 - 18.01.33	100 000	EUR	91 400	83 337	0,01
UBS Group AG FRN 20 - 14.01.28	100 000	EUR	97 873	100 955	0,01
UBS Group AG 3.75% 16 - 26.03.25	50 000	USD	48 383	48 984	0,01
UBS Group AG 4.875% 16 - 15.05.45	45 000	USD	45 943	42 944	0,01
UBS Group AG 144A FRN 21 - 10.08.27	55 000	USD	51 694	49 711	0,01
UBS Group AG 144A FRN 21 - 11.02.32	100 000	USD	89 157	79 814	0,01
UBS Group AG 144A FRN 19 - 13.08.30	30 000	USD	28 934	26 777	0,00
UBS Group AG 144A FRN 22 - 11.02.43	80 000	USD	54 234	59 265	0,01
Zuercher Kantonalbank Zero Coupon 21 - 15.05.26	100 000	EUR	107 665	102 876	0,01
			4 457 892	4 741 834	0,69
Thaïlande					
GC Treasury Center Co. Ltd. 4.30% 21 - 18.03.51	25 000	USD	23 389	18 848	0,00
			23 389	18 848	0,00
Émirats arabes unis					
Abu Dhabi 1.70% 20 - 02.03.31	200 000	USD	186 165	169 498	0,03
Abu Dhabi 2.50% 20 - 16.04.25	150 000	USD	150 113	145 461	0,02
Abu Dhabi 3.125% 16 - 03.05.26	200 000	USD	196 829	193 960	0,03
Abu Dhabi 3.125% 19 - 30.09.49	500 000	USD	455 535	367 975	0,05
Abu Dhabi 3.875% 20 - 16.04.50	300 000	USD	256 657	252 297	0,04
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 3.50% 22 - 31.03.27	250 000	USD	240 350	237 885	0,03
Emirates NBD Bank PJSC 2.625% 20 - 18.02.25	200 000	USD	199 073	193 834	0,03
First Abu Dhabi Bank PJSC 4.375% 23 - 24.04.28	280 000	USD	278 060	274 834	0,04
United Arab Emirates 4.951% 22 - 07.07.52	200 000	USD	183 744	197 098	0,03
			2 146 526	2 032 842	0,30
Royaume-Uni					
3i Group PLC 3.75% 20 - 05.06.40	100 000	GBP	131 527	102 479	0,02
Annington Funding PLC 2.924% 21 - 06.10.51	100 000	GBP	68 716	78 563	0,01
AstraZeneca PLC 0.70% 20 - 08.04.26	50 000	USD	47 621	46 054	0,01
AstraZeneca PLC 1.375% 20 - 06.08.30	25 000	USD	22 420	20 805	0,00
AstraZeneca PLC 3.125% 17 - 12.06.27	25 000	USD	25 092	24 040	0,00
AstraZeneca PLC 3.375% 15 - 16.11.25	25 000	USD	25 245	24 456	0,00
AstraZeneca PLC 3.625% 23 - 03.03.27	100 000	EUR	108 986	113 007	0,02
AstraZeneca PLC 4.375% 18 - 17.08.48	50 000	USD	55 031	47 132	0,01
AstraZeneca PLC 6.45% 07 - 15.09.37	60 000	USD	76 938	70 289	0,01
Aviva PLC FRN 16 - 12.09.49	100 000	GBP	111 545	119 051	0,02
Barclays PLC FRN 21 - 09.08.29	100 000	EUR	89 831	95 083	0,01
Barclays PLC FRN 21 - 24.11.27	65 000	USD	61 792	59 663	0,01
Barclays PLC 2.645% 20 - 24.06.31	20 000	USD	18 386	16 893	0,00
Barclays PLC FRN 21 - 10.03.32	200 000	USD	150 618	164 914	0,02
Barclays PLC FRN 20 - 07.05.26	65 000	USD	63 974	62 754	0,01
Barclays PLC FRN 21 - 24.11.32	40 000	USD	36 471	32 931	0,01
Barclays PLC 3.00% 19 - 08.05.26	100 000	GBP	131 491	120 891	0,02
Barclays PLC FRN 21 - 24.11.42	70 000	USD	51 292	51 941	0,01
Barclays PLC FRN 20 - 23.09.35	20 000	USD	18 457	17 168	0,00
Barclays PLC FRN 21 - 10.03.42	25 000	USD	22 158	18 852	0,00
Barclays PLC 4.375% 16 - 12.01.26	100 000	USD	101 254	98 548	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Barclays PLC 4.95% 17 - 10.01.47	95 000	USD	100 681	89 176	0,01
Barclays PLC FRN 19 - 20.06.30	50 000	USD	45 917	48 462	0,01
Barclays PLC 5.20% 16 - 12.05.26	40 000	USD	39 060	39 683	0,01
Barclays PLC FRN 23 - 09.05.27	150 000	USD	150 770	151 326	0,02
British Telecommunications PLC 1.125% 19 - 12.09.29	100 000	EUR	106 166	99 124	0,01
British Telecommunications PLC 5.75% 99 - 07.12.28	70 000	GBP	102 024	94 048	0,01
British Telecommunications PLC 144A 3.25% 19 - 08.11.29	75 000	USD	71 766	68 541	0,01
British Telecommunications PLC 144A 4.25% 19 - 08.11.49	25 000	USD	23 263	20 347	0,00
Cadent Finance PLC 2.125% 16 - 22.09.28	100 000	GBP	127 997	114 347	0,02
Clarion Funding PLC 1.875% 20 - 22.01.35	100 000	GBP	90 799	94 909	0,01
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0.20% 20 - 02.12.28	100 000	EUR	102 639	96 394	0,01
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.625% 20 - 12.05.35	100 000	GBP	95 936	97 414	0,01
GlaxoSmithKline Capital PLC 3.375% 19 - 01.06.29	25 000	USD	25 302	24 112	0,00
GlaxoSmithKline Capital PLC 4.00% 05 - 16.06.25	100 000	EUR	109 706	111 540	0,02
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 13.11.31	100 000	EUR	100 880	92 591	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 24.05.27	80 000	USD	75 304	73 298	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 22.09.28	85 000	USD	79 028	75 716	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 21 - 17.08.29	95 000	USD	87 574	83 021	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 21 - 22.11.27	100 000	USD	86 514	91 838	0,01
HSBC Holdings PLC 2.625% 16 - 16.08.28	100 000	GBP	128 582	117 347	0,02
HSBC Holdings PLC FRN 21 - 24.05.32	55 000	USD	50 333	45 951	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 04.06.31	55 000	USD	51 198	47 390	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 21 - 22.11.32	80 000	USD	73 193	66 658	0,01
HSBC Holdings PLC 3.90% 16 - 25.05.26	160 000	USD	154 367	155 854	0,02
HSBC Holdings PLC FRN 19 - 22.05.30	200 000	USD	198 713	186 984	0,03
HSBC Holdings PLC 4.30% 16 - 08.03.26	50 000	USD	49 204	49 191	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 18 - 19.06.29	50 000	USD	47 629	48 550	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 10.03.28	100 000	EUR	109 940	114 570	0,02
HSBC Holdings PLC FRN 22 - 09.06.28	200 000	USD	187 803	197 312	0,03
HSBC Holdings PLC 4.95% 20 - 31.03.30	50 000	USD	48 634	49 635	0,01
HSBC Holdings PLC 5.25% 14 - 14.03.44	55 000	USD	58 828	53 766	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 09.03.29	100 000	USD	103 267	103 305	0,02
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 09.03.44	100 000	USD	105 882	108 168	0,02
HSBC Holdings PLC 6.80% 08 - 01.06.38	50 000	USD	60 592	55 290	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 22 - 16.11.34	100 000	GBP	128 335	140 733	0,02
Invesco Finance PLC 3.75% 15 - 15.01.26	25 000	USD	25 304	24 344	0,00
LCR Finance PLC 4.50% 99 - 07.12.38	30 000	GBP	51 613	39 446	0,01
LCR Finance PLC 5.10% 02 - 07.03.51	20 000	GBP	42 277	28 578	0,00
Legal & General Group PLC FRN 20 - 01.11.50	100 000	GBP	134 450	117 349	0,02
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 2.375% 20 - 09.04.26	100 000	EUR	112 809	108 492	0,02
Lloyds Banking Group PLC FRN 21 - 11.05.27	15 000	USD	14 171	13 752	0,00
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 15.01.26	100 000	GBP	129 443	122 471	0,02
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 05.02.26	30 000	USD	28 681	28 958	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Banking Group PLC FRN 21 - 14.12.46	30 000	USD	24 992	20 898	0,00
Lloyds Banking Group PLC FRN 22 - 18.03.26	120 000	USD	116 686	117 172	0,02
Lloyds Banking Group PLC 3.75% 17 - 11.01.27	50 000	USD	49 941	48 068	0,01
Lloyds Banking Group PLC 4.344% 18 - 09.01.48	35 000	USD	33 651	28 211	0,00
Lloyds Banking Group PLC 4.45% 18 - 08.05.25	65 000	USD	65 813	64 221	0,01
Lloyds Banking Group PLC 4.55% 18 - 16.08.28	85 000	USD	86 701	83 778	0,01
Lloyds Banking Group PLC 5.30% 16 - 01.12.45	20 000	USD	21 595	19 205	0,00
Lloyds Banking Group PLC FRN 23 - 02.06.33	100 000	GBP	122 592	130 300	0,02
LSEGA Financing PLC 144A 1.375% 21 - 06.04.26	20 000	USD	19 125	18 474	0,00
LSEGA Financing PLC 144A 2.00% 21 - 06.04.28	20 000	USD	18 769	17 885	0,00
LSEGA Financing PLC 144A 3.20% 21 - 06.04.41	45 000	USD	40 399	35 132	0,01
Motability Operations Group PLC 1.75% 19 - 03.07.29	100 000	GBP	127 746	112 204	0,02
Nationwide Building Society 0.25% 21 - 14.09.28	100 000	EUR	95 392	96 408	0,01
Nationwide Building Society 0.625% 15 - 25.03.27	100 000	EUR	109 015	103 068	0,02
Nationwide Building Society 3.375% 23 - 27.11.28	100 000	EUR	109 385	113 150	0,02
Nationwide Building Society 4.50% 23 - 01.11.26	100 000	EUR	106 346	113 938	0,02
Nationwide Building Society 144A 1.00% 20 - 28.08.25	30 000	USD	28 925	27 994	0,00
Nationwide Building Society 144A 1.50% 21 - 13.10.26	40 000	USD	38 091	36 373	0,01
Nationwide Building Society 144A FRN 19 - 18.07.30	20 000	USD	19 963	18 685	0,00
Nationwide Building Society 144A FRN 17 - 18.10.32	25 000	USD	24 703	22 598	0,00
Nationwide Building Society 144A FRN 18 - 08.03.29	15 000	USD	15 096	14 373	0,00
NatWest Group PLC FRN 21 - 26.02.30	100 000	EUR	102 471	95 127	0,01
NatWest Group PLC FRN 18 - 19.09.26	100 000	GBP	130 988	122 105	0,02
NatWest Group PLC FRN 20 - 22.05.28	20 000	USD	19 433	18 597	0,00
NatWest Group PLC FRN 22 - 29.03.29	100 000	GBP	95 564	119 482	0,02
NatWest Group PLC FRN 19 - 08.05.30	70 000	USD	71 192	66 980	0,01
NatWest Group PLC FRN 18 - 18.05.29	35 000	USD	35 975	34 431	0,01
NatWest Group PLC FRN 22 - 10.11.26	160 000	USD	164 696	165 586	0,02
NatWest Markets PLC 1.375% 22 - 02.03.27	150 000	EUR	147 579	155 948	0,02
NatWest Markets PLC 144A 1.60% 21 - 29.09.26	70 000	USD	66 426	63 976	0,01
Network Rail Infrastructure Finance PLC 4.375% 05 - 09.12.30	50 000	GBP	76 839	65 951	0,01
Prudential Funding Asia PLC 3.125% 20 - 14.04.30	55 000	USD	53 564	49 730	0,01
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 144A 3.00% 17 - 26.06.27	50 000	USD	49 421	47 501	0,01
Royalty Pharma PLC 2.15% 21 - 02.09.31	50 000	USD	39 299	40 877	0,01
Royalty Pharma PLC 3.30% 21 - 02.09.40	50 000	USD	35 149	37 755	0,01
Santander UK Group Holdings PLC FRN 20 - 21.08.26	90 000	USD	85 937	83 975	0,01
Santander UK Group Holdings PLC FRN 17 - 03.11.28	100 000	USD	98 805	94 078	0,01
Santander UK PLC 1.125% 22 - 12.03.27	100 000	EUR	100 892	104 415	0,02
Sky Ltd. 2.50% 14 - 15.09.26	100 000	EUR	114 332	108 832	0,02
Standard Chartered PLC FRN 21 - 23.09.31	100 000	EUR	104 182	100 203	0,02
Standard Chartered PLC 144A FRN 21 - 14.01.27	80 000	USD	75 517	73 349	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Standard Chartered PLC 144A FRN 22 - 12.01.28	155 000	USD	141 581	141 834	0,02
Standard Chartered PLC 144A FRN 20 - 18.02.36	55 000	USD	49 450	45 079	0,01
Standard Chartered PLC 144A FRN 22 - 30.03.26	100 000	USD	98 103	97 543	0,01
Standard Chartered PLC 144A 4.30% 16 - 19.02.27	25 000	USD	25 017	23 910	0,00
Standard Chartered PLC 144A FRN 19 - 21.05.30	20 000	USD	20 169	18 728	0,00
Standard Chartered PLC 144A 5.70% 14 - 26.03.44	65 000	USD	69 104	62 960	0,01
Tesco Property Finance 3 PLC 5.744% 10 - 13.04.40	45 023	GBP	69 159	58 079	0,01
Tesco Property Finance 5 PLC 5.661% 12 - 13.10.41	93 981	GBP	144 278	120 773	0,02
Thames Water Utilities Finance PLC 2.375% 20 - 22.04.40	100 000	GBP	117 356	78 162	0,01
Thames Water Utilities Finance PLC 4.00% 23 - 18.04.27	100 000	EUR	108 501	106 910	0,02
Trinity Acquisition PLC 4.40% 16 - 15.03.26	30 000	USD	30 599	29 642	0,00
Unilever PLC 1.50% 19 - 11.06.39	100 000	EUR	105 528	89 622	0,01
United Kingdom 0.125% 20 - 30.01.26	429 000	GBP	528 340	508 640	0,07
United Kingdom 0.125% 20 - 31.01.28	361 112	GBP	426 027	404 050	0,06
United Kingdom 0.25% 20 - 31.07.31	510 000	GBP	559 671	514 286	0,08
United Kingdom 0.25% 21 - 31.01.25	523 000	GBP	628 465	638 158	0,09
United Kingdom 0.375% 20 - 22.10.30	592 698	GBP	636 126	618 851	0,09
United Kingdom 0.375% 21 - 22.10.26	483 000	GBP	596 561	564 530	0,08
United Kingdom 0.50% 20 - 22.10.61	321 000	GBP	241 902	137 920	0,02
United Kingdom 0.50% 21 - 31.01.29	361 000	GBP	397 849	399 626	0,06
United Kingdom 0.625% 19 - 07.06.25	489 000	GBP	611 226	594 053	0,09
United Kingdom 0.625% 20 - 22.10.50	420 000	GBP	336 022	236 482	0,03
United Kingdom 0.625% 20 - 31.07.35	474 000	GBP	498 587	429 849	0,06
United Kingdom 0.875% 19 - 22.10.29	521 000	GBP	604 931	580 080	0,09
United Kingdom 0.875% 21 - 31.01.46	256 000	GBP	256 782	174 577	0,03
United Kingdom 0.875% 21 - 31.07.33	368 000	GBP	397 224	367 509	0,05
United Kingdom 1.00% 21 - 31.01.32	531 000	GBP	533 152	561 233	0,08
United Kingdom 1.125% 21 - 31.01.39	310 000	GBP	275 005	268 870	0,04
United Kingdom 1.125% 22 - 22.10.73	130 000	GBP	107 109	69 430	0,01
United Kingdom 1.25% 17 - 22.07.27	644 000	GBP	774 944	762 329	0,11
United Kingdom 1.25% 20 - 22.10.41	433 000	GBP	429 505	358 500	0,05
United Kingdom 1.25% 21 - 31.07.51	365 000	GBP	328 415	247 983	0,04
United Kingdom 1.50% 16 - 22.07.26	525 000	GBP	672 636	636 462	0,09
United Kingdom 1.50% 16 - 22.07.47	303 000	GBP	358 327	234 401	0,03
United Kingdom 1.50% 21 - 31.07.53	225 000	GBP	179 430	159 977	0,02
United Kingdom 1.625% 18 - 22.10.28	441 000	GBP	586 671	520 624	0,08
United Kingdom 1.625% 18 - 22.10.71	340 000	GBP	360 336	223 660	0,03
United Kingdom 1.625% 19 - 22.10.54	303 000	GBP	345 158	221 183	0,03
United Kingdom 1.75% 16 - 07.09.37	402 000	GBP	457 057	398 045	0,06
United Kingdom 1.75% 17 - 22.07.57	356 000	GBP	467 797	264 764	0,04
United Kingdom 1.75% 18 - 22.01.49	365 000	GBP	396 120	294 429	0,04
United Kingdom 2.00% 15 - 07.09.25	441 222	GBP	559 100	545 522	0,08
United Kingdom 2.50% 15 - 22.07.65	239 000	GBP	357 067	213 594	0,03
United Kingdom 3.25% 12 - 22.01.44	388 893	GBP	555 135	436 968	0,06
United Kingdom 3.25% 23 - 31.01.33	450 000	GBP	538 027	561 355	0,08
United Kingdom 3.50% 13 - 22.07.68	315 000	GBP	501 941	360 936	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.50% 14 - 22.01.45	393 000	GBP	564 606	456 528	0,07
United Kingdom 3.50% 23 - 22.10.25	400 000	GBP	495 344	505 881	0,07
United Kingdom 3.75% 11 - 22.07.52	361 000	GBP	630 438	432 365	0,06
United Kingdom 3.75% 22 - 29.01.38	250 000	GBP	294 722	312 367	0,05
United Kingdom 3.75% 23 - 22.10.53	321 000	GBP	369 408	382 330	0,06
United Kingdom 4.00% 09 - 22.01.60	335 000	GBP	667 688	421 455	0,06
United Kingdom 4.00% 23 - 22.10.63	120 000	GBP	135 715	151 162	0,02
United Kingdom 4.125% 22 - 29.01.27	430 000	GBP	521 811	556 688	0,08
United Kingdom 4.25% 00 - 07.06.32	457 000	GBP	690 904	616 997	0,09
United Kingdom 4.25% 03 - 07.03.36	405 000	GBP	611 822	541 308	0,08
United Kingdom 4.25% 05 - 07.12.55	319 000	GBP	563 297	417 133	0,06
United Kingdom 4.25% 06 - 07.12.46	325 000	GBP	540 140	420 027	0,06
United Kingdom 4.25% 06 - 07.12.27	494 000	GBP	665 234	649 450	0,10
United Kingdom 4.25% 08 - 07.12.49	280 000	GBP	487 931	363 051	0,05
United Kingdom 4.25% 09 - 07.09.39	314 000	GBP	510 604	411 951	0,06
United Kingdom 4.25% 10 - 07.12.40	300 000	GBP	442 274	392 257	0,06
United Kingdom 4.50% 07 - 07.12.42	371 000	GBP	666 138	498 897	0,07
United Kingdom 4.50% 09 - 07.09.34	431 000	GBP	664 176	590 048	0,09
United Kingdom 4.50% 23 - 07.06.28	270 000	GBP	331 382	358 945	0,05
United Kingdom 4.625% 23 - 31.01.34	100 000	GBP	121 617	138 388	0,02
United Kingdom 4.75% 04 - 07.12.38	304 000	GBP	552 987	422 728	0,06
United Kingdom 4.75% 07 - 07.12.30	560 000	GBP	805 353	772 562	0,11
United Kingdom 4.75% 23 - 22.10.43	89 000	GBP	113 866	122 870	0,02
United Kingdom 5.00% 01 - 07.03.25	432 000	GBP	564 337	555 543	0,08
United Kingdom 6.00% 98 - 07.12.28	280 000	GBP	398 280	399 509	0,06
United Utilities Water Finance PLC 5.75% 23 - 26.06.36	100 000	GBP	124 887	137 678	0,02
Vodafone Group PLC 1.625% 19 - 24.11.30	100 000	EUR	109 434	100 188	0,02
Vodafone Group PLC 1.875% 14 - 11.09.25	100 000	EUR	112 026	107 676	0,02
Vodafone Group PLC 4.125% 18 - 30.05.25	25 000	USD	25 350	24 695	0,00
Vodafone Group PLC 4.25% 19 - 17.09.50	140 000	USD	113 887	116 526	0,02
Vodafone Group PLC 4.375% 13 - 19.02.43	25 000	USD	24 652	21 873	0,00
Vodafone Group PLC 4.375% 18 - 30.05.28	50 000	USD	51 548	49 969	0,01
Vodafone Group PLC 5.00% 18 - 30.05.38	75 000	USD	80 923	75 471	0,01
Vodafone Group PLC 5.90% 02 - 26.11.32	60 000	GBP	96 166	83 864	0,01
Vodafone Group PLC 7.875% 00 - 15.02.30	25 000	USD	30 166	28 699	0,00
Wellcome Trust Finance PLC 4.625% 06 - 25.07.36	50 000	GBP	81 947	66 145	0,01
Westfield Stratford City Finance NO 2 PLC 1.642% 19 - 04.08.26	100 000	GBP	128 569	115 712	0,02
Yorkshire Building Society 0.625% 20 - 21.09.25	100 000	EUR	108 876	104 870	0,02
			38 058 601	34 172 452	4,99
États-Unis					
3M Co. 1.50% 14 - 09.11.26	100 000	EUR	106 178	104 123	0,02
3M Co. 2.875% 17 - 15.10.27	100 000	USD	99 773	94 166	0,01
3M Co. 3.70% 20 - 15.04.50	100 000	USD	99 559	79 583	0,01
ABB Finance Inc. 4.375% 12 - 08.05.42	25 000	USD	26 550	23 071	0,00
Abbott Laboratories 4.75% 16 - 30.11.36	40 000	USD	41 512	41 014	0,01
Abbott Laboratories 4.90% 16 - 30.11.46	50 000	USD	48 193	51 357	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Abbott Laboratories 6.15% 07 - 30.11.37	100 000	USD	109 390	115 291	0,02
AbbVie Inc. 2.95% 20 - 21.11.26	50 000	USD	47 496	47 962	0,01
AbbVie Inc. 3.20% 16 - 14.05.26	100 000	USD	100 173	96 929	0,01
AbbVie Inc. 3.20% 20 - 21.11.29	100 000	USD	98 663	93 529	0,01
AbbVie Inc. 3.60% 15 - 14.05.25	75 000	USD	75 511	73 663	0,01
AbbVie Inc. 4.05% 20 - 21.11.39	60 000	USD	54 442	54 353	0,01
AbbVie Inc. 4.25% 18 - 14.11.28	25 000	USD	25 937	24 890	0,00
AbbVie Inc. 4.25% 20 - 21.11.49	100 000	USD	86 873	89 383	0,01
AbbVie Inc. 4.40% 13 - 06.11.42	150 000	USD	136 065	139 536	0,02
AbbVie Inc. 4.50% 15 - 14.05.35	125 000	USD	131 731	122 382	0,02
AbbVie Inc. 4.75% 20 - 15.03.45	16 000	USD	17 032	15 424	0,00
AbbVie Inc. 4.875% 18 - 14.11.48	125 000	USD	137 312	122 420	0,02
Adobe Inc. 2.30% 20 - 01.02.30	75 000	USD	71 511	67 347	0,01
Aetna Inc. 3.875% 17 - 15.08.47	25 000	USD	24 097	19 630	0,00
Aetna Inc. 6.625% 06 - 15.06.36	25 000	USD	30 702	28 020	0,00
Aetna Inc. 6.75% 07 - 15.12.37	25 000	USD	31 123	28 142	0,00
Aflac Inc. 3.60% 20 - 01.04.30	75 000	USD	76 598	71 005	0,01
Agilent Technologies Inc. 2.30% 21 - 12.03.31	50 000	USD	45 889	43 389	0,01
Air Lease Corp. 1.875% 21 - 15.08.26	45 000	USD	42 768	41 434	0,01
Air Lease Corp. 2.10% 21 - 01.09.28	20 000	USD	18 293	17 548	0,00
Air Lease Corp. 2.30% 20 - 01.02.25	55 000	USD	54 224	53 074	0,01
Air Lease Corp. 2.875% 20 - 15.01.26	40 000	USD	39 194	38 135	0,01
Air Lease Corp. 3.00% 20 - 01.02.30	25 000	USD	23 367	22 200	0,00
Air Lease Corp. 3.25% 19 - 01.10.29	10 000	USD	9 470	9 054	0,00
Air Lease Corp. 3.375% 20 - 01.07.25	80 000	USD	76 984	77 484	0,01
Air Lease Corp. 3.625% 17 - 01.12.27	10 000	USD	9 790	9 475	0,00
Air Products and Chemicals Inc. 2.05% 20 - 15.05.30	25 000	USD	23 413	21 896	0,00
Air Products and Chemicals Inc. 2.70% 20 - 15.05.40	25 000	USD	22 320	19 112	0,00
Air Products and Chemicals Inc. 2.80% 20 - 15.05.50	25 000	USD	21 628	17 919	0,00
Alexandria Real Estate Equities Inc. 2.00% 21 - 18.05.32	125 000	USD	98 408	100 350	0,02
Alexandria Real Estate Equities Inc. 3.375% 19 - 15.08.31	50 000	USD	49 220	45 149	0,01
Alexandria Real Estate Equities Inc. 4.00% 19 - 01.02.50	50 000	USD	48 969	39 669	0,01
Allstate Corp. 0.75% 20 - 15.12.25	10 000	USD	9 616	9 224	0,00
Allstate Corp. 1.45% 20 - 15.12.30	10 000	USD	8 867	8 100	0,00
Allstate Corp. 3.28% 16 - 15.12.26	10 000	USD	10 060	9 649	0,00
Allstate Corp. 3.85% 19 - 10.08.49	10 000	USD	9 902	8 103	0,00
Allstate Corp. 4.20% 16 - 15.12.46	30 000	USD	31 108	25 549	0,00
Allstate Corp. 5.55% 05 - 09.05.35	15 000	USD	17 353	15 607	0,00
Allstate Corp. FRN 07 - 15.05.57	10 000	USD	11 999	9 937	0,00
Ally Financial Inc. 2.20% 21 - 02.11.28	15 000	USD	13 896	12 836	0,00
Ally Financial Inc. 4.625% 15 - 30.03.25	70 000	USD	69 121	69 088	0,01
Ally Financial Inc. FRN 23 - 13.06.29	50 000	USD	50 287	51 768	0,01
Ally Financial Inc. 8.00% 08 - 01.11.31	45 000	USD	53 610	49 358	0,01
Alphabet Inc. 0.45% 20 - 15.08.25	25 000	USD	24 231	23 469	0,00
Alphabet Inc. 0.80% 20 - 15.08.27	25 000	USD	23 387	22 365	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Alphabet Inc. 1.10% 20 - 15.08.30	50 000	USD	44 770	41 524	0,01
Alphabet Inc. 1.90% 20 - 15.08.40	25 000	USD	20 651	17 398	0,00
Alphabet Inc. 1.998% 16 - 15.08.26	25 000	USD	24 648	23 624	0,00
Alphabet Inc. 2.05% 20 - 15.08.50	50 000	USD	39 384	31 387	0,01
Alphabet Inc. 2.25% 20 - 15.08.60	90 000	USD	55 941	56 101	0,01
Amazon.com Inc. 0.80% 20 - 03.06.25	50 000	USD	48 819	47 382	0,01
Amazon.com Inc. 1.00% 21 - 12.05.26	50 000	USD	48 271	46 234	0,01
Amazon.com Inc. 1.20% 20 - 03.06.27	100 000	USD	94 960	90 304	0,01
Amazon.com Inc. 1.50% 20 - 03.06.30	25 000	USD	22 890	21 198	0,00
Amazon.com Inc. 1.65% 21 - 12.05.28	50 000	USD	47 474	45 059	0,01
Amazon.com Inc. 2.10% 21 - 12.05.31	50 000	USD	46 986	43 126	0,01
Amazon.com Inc. 2.50% 20 - 03.06.50	200 000	USD	166 003	133 554	0,02
Amazon.com Inc. 2.70% 20 - 03.06.60	90 000	USD	73 774	59 848	0,01
Amazon.com Inc. 2.875% 21 - 12.05.41	125 000	USD	114 990	98 285	0,01
Amazon.com Inc. 3.00% 22 - 13.04.25	50 000	USD	49 018	48 970	0,01
Amazon.com Inc. 3.30% 22 - 13.04.27	50 000	USD	47 928	48 575	0,01
Amazon.com Inc. 3.60% 22 - 13.04.32	100 000	USD	98 400	95 268	0,01
Amazon.com Inc. 3.875% 18 - 22.08.37	120 000	USD	112 754	111 612	0,02
Amazon.com Inc. 3.95% 22 - 13.04.52	25 000	USD	22 282	21 958	0,00
Amazon.com Inc. 4.70% 22 - 01.12.32	50 000	USD	49 874	51 437	0,01
Amazon.com Inc. 4.80% 14 - 05.12.34	25 000	USD	28 061	25 909	0,00
Amazon.com Inc. 4.95% 14 - 05.12.44	25 000	USD	29 577	25 849	0,00
American Express Co. 2.25% 22 - 04.03.25	50 000	USD	48 164	48 385	0,01
American Express Co. 2.55% 22 - 04.03.27	50 000	USD	46 976	46 873	0,01
American Express Co. 3.125% 19 - 20.05.26	80 000	USD	76 680	77 203	0,01
American Express Co. 3.30% 22 - 03.05.27	30 000	USD	30 027	28 696	0,00
American Express Co. 4.05% 13 - 03.12.42	75 000	USD	69 767	67 900	0,01
American Express Co. 4.20% 18 - 06.11.25	15 000	USD	15 318	14 832	0,00
American Express Co. FRN 22 - 03.08.33	50 000	USD	47 323	48 205	0,01
American Express Co. 5.85% 22 - 05.11.27	150 000	USD	155 267	156 621	0,02
American Honda Finance Corp. 1.00% 20 - 10.09.25	50 000	USD	48 359	47 026	0,01
American Honda Finance Corp. 1.30% 21 - 09.09.26	25 000	USD	23 894	22 986	0,00
American Honda Finance Corp. 2.00% 21 - 24.03.28	25 000	USD	23 719	22 687	0,00
American Honda Finance Corp. 5.25% 23 - 07.07.26	80 000	USD	80 336	81 458	0,01
American International Group Inc. 3.875% 15 - 15.01.35	25 000	USD	23 688	22 725	0,00
American International Group Inc. 4.375% 20 - 30.06.50	45 000	USD	47 316	40 425	0,01
American International Group Inc. 4.75% 18 - 01.04.48	20 000	USD	18 240	18 992	0,00
American Tower Corp. 0.875% 21 - 21.05.29	100 000	EUR	93 927	96 296	0,01
American Tower Corp. 2.10% 20 - 15.06.30	50 000	USD	44 736	42 029	0,01
American Tower Corp. 2.30% 21 - 15.09.31	50 000	USD	44 421	41 477	0,01
American Tower Corp. 2.40% 20 - 15.03.25	50 000	USD	49 550	48 366	0,01
American Tower Corp. 2.75% 19 - 15.01.27	50 000	USD	48 769	46 926	0,01
American Tower Corp. 2.90% 20 - 15.01.30	50 000	USD	47 125	44 723	0,01
American Tower Corp. 2.95% 20 - 15.01.51	50 000	USD	32 795	33 453	0,01
American Tower Corp. 3.375% 16 - 15.10.26	50 000	USD	47 441	47 943	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
American Tower Corp. 3.55% 17 - 15.07.27	50 000	USD	49 741	48 038	0,01
American Tower Corp. 3.70% 19 - 15.10.49	25 000	USD	22 148	19 034	0,00
American Tower Corp. 3.80% 19 - 15.08.29	43 000	USD	40 038	40 859	0,01
American Water Capital Corp. 2.80% 20 - 01.05.30	25 000	USD	24 194	22 424	0,00
American Water Capital Corp. 3.40% 14 - 01.03.25	50 000	USD	49 409	48 947	0,01
American Water Capital Corp. 3.45% 20 - 01.05.50	125 000	USD	115 151	95 810	0,01
Ameriprise Financial Inc. 3.00% 20 - 02.04.25	50 000	USD	50 032	48 761	0,01
Amgen Inc. 1.65% 21 - 15.08.28	25 000	USD	23 393	22 123	0,00
Amgen Inc. 2.00% 21 - 15.01.32	25 000	USD	22 580	20 518	0,00
Amgen Inc. 2.30% 20 - 25.02.31	25 000	USD	23 273	21 395	0,00
Amgen Inc. 2.45% 20 - 21.02.30	25 000	USD	23 797	22 200	0,00
Amgen Inc. 2.77% 21 - 01.09.53	25 000	USD	20 026	16 097	0,00
Amgen Inc. 3.125% 15 - 01.05.25	20 000	USD	19 454	19 500	0,00
Amgen Inc. 3.15% 20 - 21.02.40	25 000	USD	22 731	19 488	0,00
Amgen Inc. 3.20% 17 - 02.11.27	25 000	USD	25 108	23 908	0,00
Amgen Inc. 3.375% 20 - 21.02.50	80 000	USD	56 744	59 740	0,01
Amgen Inc. 4.40% 15 - 01.05.45	50 000	USD	51 490	44 539	0,01
Amgen Inc. 4.563% 17 - 15.06.48	80 000	USD	77 912	72 398	0,01
Amgen Inc. 4.663% 17 - 15.06.51	150 000	USD	160 213	137 002	0,02
Amgen Inc. 5.15% 23 - 02.03.28	200 000	USD	201 817	204 642	0,03
Amgen Inc. 5.25% 23 - 02.03.25	100 000	USD	100 735	100 217	0,02
Amgen Inc. 5.60% 23 - 02.03.43	50 000	USD	52 481	51 763	0,01
Amgen Inc. 5.65% 23 - 02.03.53	80 000	USD	79 367	84 502	0,01
Amgen Inc. 5.75% 23 - 02.03.63	80 000	USD	78 925	84 340	0,01
Amphenol Corp. 2.20% 21 - 15.09.31	50 000	USD	45 317	42 163	0,01
Analog Devices Inc. 2.10% 21 - 01.10.31	25 000	USD	23 261	21 334	0,00
Analog Devices Inc. 2.80% 21 - 01.10.41	25 000	USD	22 424	18 724	0,00
Analog Devices Inc. 2.95% 21 - 01.10.51	25 000	USD	22 231	17 994	0,00
Analog Devices Inc. 3.50% 16 - 05.12.26	25 000	USD	25 390	24 422	0,00
Apple Inc. 0.55% 20 - 20.08.25	100 000	USD	96 854	93 949	0,01
Apple Inc. 1.20% 21 - 08.02.28	100 000	USD	93 543	89 066	0,01
Apple Inc. 1.25% 20 - 20.08.30	50 000	USD	44 876	41 571	0,01
Apple Inc. 1.375% 17 - 24.05.29	100 000	EUR	107 220	103 789	0,02
Apple Inc. 1.40% 21 - 05.08.28	80 000	USD	70 311	70 933	0,01
Apple Inc. 1.65% 21 - 08.02.31	75 000	USD	68 672	63 293	0,01
Apple Inc. 2.05% 19 - 11.09.26	100 000	USD	98 279	94 332	0,01
Apple Inc. 2.20% 19 - 11.09.29	25 000	USD	24 003	22 650	0,00
Apple Inc. 2.375% 21 - 08.02.41	25 000	USD	21 744	18 362	0,00
Apple Inc. 2.40% 20 - 20.08.50	50 000	USD	41 307	32 872	0,01
Apple Inc. 2.80% 21 - 08.02.61	125 000	USD	102 837	85 392	0,01
Apple Inc. 2.90% 17 - 12.09.27	100 000	USD	100 223	95 810	0,01
Apple Inc. 2.95% 19 - 11.09.49	117 000	USD	106 933	86 259	0,01
Apple Inc. 3.20% 15 - 13.05.25	100 000	USD	97 670	98 036	0,01
Apple Inc. 3.20% 17 - 11.05.27	100 000	USD	98 325	96 904	0,01
Apple Inc. 3.35% 17 - 09.02.27	20 000	USD	19 633	19 491	0,00
Apple Inc. 3.60% 15 - 31.07.42	100 000	GBP	150 048	115 841	0,02
Apple Inc. 3.75% 17 - 12.09.47	60 000	USD	57 046	51 449	0,01
Apple Inc. 3.85% 13 - 04.05.43	100 000	USD	96 250	89 322	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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. 3.85% 16 - 04.08.46	25 000	USD	22 417	21 838	0,00
Apple Inc. 4.25% 17 - 09.02.47	25 000	USD	27 482	23 679	0,00
Apple Inc. 4.50% 16 - 23.02.36	165 000	USD	171 140	168 868	0,03
Apple Inc. 4.65% 16 - 23.02.46	100 000	USD	91 830	98 829	0,01
Applied Materials Inc. 3.30% 17 - 01.04.27	25 000	USD	25 238	24 236	0,00
Applied Materials Inc. 4.35% 17 - 01.04.47	25 000	USD	27 642	23 693	0,00
Applied Materials Inc. 5.10% 15 - 01.10.35	50 000	USD	56 893	52 627	0,01
Ashtead Capital Inc. 144A 2.45% 21 - 12.08.31	30 000	USD	26 973	24 462	0,00
Ashtead Capital Inc. 144A 4.25% 19 - 01.11.29	30 000	USD	30 231	28 016	0,00
Ashtead Capital Inc. 144A 4.375% 17 - 15.08.27	50 000	USD	47 266	48 033	0,01
Astrazeneca Finance LLC 1.75% 21 - 28.05.28	50 000	USD	47 232	44 826	0,01
Astrazeneca Finance LLC 2.25% 21 - 28.05.31	25 000	USD	23 504	21 600	0,00
AstraZeneca Finance LLC 1.20% 21 - 28.05.26	50 000	USD	45 954	46 297	0,01
AT&T Inc. 0.25% 19 - 04.03.26	100 000	EUR	92 700	103 701	0,02
AT&T Inc. 1.65% 20 - 01.02.28	100 000	USD	89 997	89 130	0,01
AT&T Inc. 1.70% 21 - 25.03.26	160 000	USD	148 653	149 691	0,02
AT&T Inc. 2.05% 20 - 19.05.32	100 000	EUR	84 825	99 728	0,02
AT&T Inc. 2.35% 18 - 05.09.29	100 000	EUR	98 341	105 860	0,02
AT&T Inc. 2.55% 21 - 01.12.33	300 000	USD	236 395	244 692	0,04
AT&T Inc. 3.15% 17 - 04.09.36	100 000	EUR	93 609	102 882	0,02
AT&T Inc. 3.50% 20 - 01.06.41	120 000	USD	96 265	95 515	0,01
AT&T Inc. 3.50% 21 - 15.09.53	105 000	USD	76 285	76 534	0,01
AT&T Inc. 3.55% 21 - 15.09.55	180 000	USD	117 930	130 055	0,02
AT&T Inc. 3.65% 20 - 01.06.51	70 000	USD	48 589	52 870	0,01
AT&T Inc. 3.65% 21 - 15.09.59	130 000	USD	86 223	93 518	0,01
AT&T Inc. 3.80% 19 - 15.02.27	65 000	USD	62 807	63 469	0,01
AT&T Inc. 3.80% 21 - 01.12.57	150 000	USD	102 999	111 934	0,02
AT&T Inc. 3.85% 20 - 01.06.60	75 000	USD	56 501	56 178	0,01
AT&T Inc. 4.00% 18 - 25.11.25	50 000	CAD	37 136	37 337	0,01
AT&T Inc. 4.35% 19 - 01.03.29	200 000	USD	189 327	197 498	0,03
AT&T Inc. 4.75% 15 - 15.05.46	40 000	USD	33 758	36 353	0,01
AT&T Inc. 5.10% 18 - 25.11.48	25 000	CAD	17 067	18 289	0,00
AT&T Inc. 5.20% 16 - 18.11.33	100 000	GBP	118 852	130 160	0,02
Atmos Energy Corp. 3.00% 17 - 15.06.27	25 000	USD	24 919	23 853	0,00
Atmos Energy Corp. 3.375% 19 - 15.09.49	80 000	USD	71 178	61 124	0,01
Autodesk Inc. 2.40% 21 - 15.12.31	25 000	USD	22 779	21 433	0,00
Automatic Data Processing Inc. 1.70% 21 - 15.05.28	75 000	USD	71 229	67 783	0,01
AutoZone Inc. 3.75% 17 - 01.06.27	75 000	USD	71 792	72 897	0,01
AvalonBay Communities Inc. 2.05% 21 - 15.01.32	50 000	USD	45 698	41 880	0,01
AvalonBay Communities Inc. 2.30% 20 - 01.03.30	50 000	USD	42 644	43 645	0,01
Avangrid Inc. 3.20% 20 - 15.04.25	75 000	USD	74 334	72 925	0,01
Avangrid Inc. 3.80% 19 - 01.06.29	25 000	USD	25 153	23 550	0,00
Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc. 3.337% 18 - 15.12.27	50 000	USD	46 207	47 873	0,01
Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc. 4.08% 18 - 15.12.47	75 000	USD	57 218	63 797	0,01
Bank of America Corp. FRN 21 - 24.08.28	100 000	EUR	94 541	99 551	0,02
Bank of America Corp. FRN 19 - 09.05.26	100 000	EUR	109 045	106 164	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Bank of America Corp. FRN 20 - 24.10.26	185 000	USD	170 516	171 748	0,03
Bank of America Corp. FRN 21 - 11.03.27	100 000	USD	93 980	92 534	0,01
Bank of America Corp. FRN 21 - 22.07.27	70 000	USD	66 757	64 138	0,01
Bank of America Corp. FRN 20 - 23.07.31	255 000	USD	227 783	208 455	0,03
Bank of America Corp. FRN 21 - 15.09.27	12 000	CAD	9 086	8 483	0,00
Bank of America Corp. FRN 21 - 14.06.29	80 000	USD	74 552	70 635	0,01
Bank of America Corp. FRN 20 - 13.02.31	75 000	USD	63 115	64 488	0,01
Bank of America Corp. FRN 21 - 20.10.32	100 000	USD	79 912	83 073	0,01
Bank of America Corp. FRN 21 - 11.03.32	50 000	USD	42 548	42 244	0,01
Bank of America Corp. FRN 20 - 19.06.41	150 000	USD	114 776	107 713	0,02
Bank of America Corp. FRN 21 - 22.04.32	50 000	USD	44 117	42 254	0,01
Bank of America Corp. FRN 22 - 27.04.33	100 000	EUR	98 968	103 645	0,02
Bank of America Corp. FRN 22 - 04.02.33	225 000	USD	212 064	191 452	0,03
Bank of America Corp. FRN 19 - 23.07.30	140 000	USD	136 100	127 095	0,02
Bank of America Corp. FRN 18 - 20.12.28	200 000	USD	189 391	188 454	0,03
Bank of America Corp. FRN 20 - 24.03.26	30 000	CAD	23 967	22 294	0,00
Bank of America Corp. FRN 19 - 23.04.27	100 000	USD	95 301	96 308	0,01
Bank of America Corp. FRN 22 - 16.03.28	20 000	CAD	15 833	14 695	0,00
Bank of America Corp. FRN 17 - 24.04.28	100 000	USD	100 346	95 602	0,01
Bank of America Corp. FRN 17 - 20.01.28	25 000	USD	24 138	24 050	0,00
Bank of America Corp. FRN 22 - 08.03.37	120 000	USD	103 436	105 461	0,02
Bank of America Corp. FRN 18 - 05.03.29	105 000	USD	105 883	100 346	0,02
Bank of America Corp. 4.00% 15 - 22.01.25	50 000	USD	48 853	49 322	0,01
Bank of America Corp. FRN 19 - 23.04.40	170 000	USD	163 553	149 319	0,02
Bank of America Corp. FRN 17 - 24.04.38	50 000	USD	45 428	45 180	0,01
Bank of America Corp. FRN 19 - 15.03.50	50 000	USD	43 277	43 998	0,01
Bank of America Corp. FRN 17 - 20.01.48	100 000	USD	97 770	90 130	0,01
Bank of America Corp. FRN 22 - 27.04.33	170 000	USD	162 792	162 382	0,02
Bank of America Corp. FRN 22 - 22.07.26	100 000	USD	99 211	99 276	0,02
Bank of America Corp. 5.00% 14 - 21.01.44	60 000	USD	66 705	59 216	0,01
Bank of America Corp. FRN 22 - 22.07.33	200 000	USD	198 708	198 300	0,03
Bank of America Corp. FRN 23 - 20.01.27	100 000	USD	98 743	99 845	0,02
Bank of America Corp. FRN 23 - 25.04.29	50 000	USD	49 634	50 348	0,01
Bank of America Corp. 6.11% 07 - 29.01.37	125 000	USD	130 735	133 751	0,02
Bank of America Corp. 7.00% 08 - 31.07.28	50 000	GBP	65 855	70 359	0,01
Bank of New York Mellon Corp. 0.75% 21 - 28.01.26	120 000	USD	111 014	110 627	0,02
Bank of New York Mellon Corp. 1.05% 21 - 15.10.26	35 000	USD	33 249	31 710	0,01
Bank of New York Mellon Corp. 1.60% 20 - 24.04.25	35 000	USD	34 476	33 596	0,01
Bank of New York Mellon Corp. 1.65% 21 - 14.07.28	55 000	USD	51 656	48 438	0,01
Bank of New York Mellon Corp. 1.80% 21 - 28.07.31	70 000	USD	60 944	57 229	0,01
Bank of New York Mellon Corp. 3.25% 17 - 16.05.27	30 000	USD	30 202	28 775	0,00
Bank of New York Mellon Corp. 3.30% 17 - 23.08.29	15 000	USD	14 935	14 059	0,00
Bank of New York Mellon Corp. FRN 23 - 26.04.34	50 000	USD	48 738	49 869	0,01
Bank of New York Mellon Corp. FRN 22 - 25.10.28	100 000	USD	100 603	103 767	0,02
Baxter International Inc. 1.73% 21 - 01.04.31	100 000	USD	78 879	81 428	0,01
Baxter International Inc. 2.539% 22 - 01.02.32	27 000	USD	25 068	22 691	0,00
Baxter International Inc. 3.132% 22 - 01.12.51	50 000	USD	42 754	34 562	0,01
Becton Dickinson & Co. 2.823% 20 - 20.05.30	125 000	USD	119 595	111 909	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Becton Dickinson & Co. 3.794% 20 - 20.05.50	34 000	USD	32 222	27 789	0,00
Becton Dickinson & Co. 4.669% 17 - 06.06.47	25 000	USD	23 152	23 380	0,00
Best Buy Co. Inc. 1.95% 20 - 01.10.30	75 000	USD	61 463	62 392	0,01
Biogen Inc. 2.25% 20 - 01.05.30	25 000	USD	22 774	21 371	0,00
Biogen Inc. 3.25% 22 - 15.02.51	75 000	USD	61 923	53 873	0,01
Biogen Inc. 4.05% 15 - 15.09.25	25 000	USD	25 336	24 599	0,00
BlackRock Inc. 2.10% 21 - 25.02.32	50 000	USD	45 639	41 859	0,01
BlackRock Inc. 3.20% 17 - 15.03.27	70 000	USD	70 699	67 836	0,01
BMW US Capital LLC 1.00% 15 - 20.04.27	30 000	EUR	32 785	31 261	0,01
Booking Holdings Inc. 3.60% 16 - 01.06.26	50 000	USD	50 591	48 882	0,01
Booking Holdings Inc. 4.125% 23 - 12.05.33	100 000	EUR	107 663	117 881	0,02
Booking Holdings Inc. 4.25% 22 - 15.05.29	100 000	EUR	105 664	116 901	0,02
BorgWarner Inc. 2.65% 20 - 01.07.27	25 000	USD	24 498	23 188	0,00
Boston Properties LP 2.75% 16 - 01.10.26	25 000	USD	24 587	23 216	0,00
Boston Properties LP 2.90% 19 - 15.03.30	50 000	USD	47 634	42 885	0,01
Boston Properties LP 3.20% 17 - 15.01.25	25 000	USD	25 025	24 306	0,00
Boston Properties LP 3.25% 20 - 30.01.31	25 000	USD	24 129	21 505	0,00
Boston Properties LP 3.65% 16 - 01.02.26	25 000	USD	25 178	24 088	0,00
Boston Properties LP 4.50% 18 - 01.12.28	25 000	USD	25 930	23 801	0,00
Boston Scientific Corp. 0.625% 19 - 01.12.27	100 000	EUR	97 670	100 945	0,02
Boston Scientific Corp. 4.70% 19 - 01.03.49	50 000	USD	46 559	48 236	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 0.75% 20 - 13.11.25	50 000	USD	46 404	46 668	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 1.125% 20 - 13.11.27	50 000	USD	43 765	44 458	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 1.45% 20 - 13.11.30	25 000	USD	22 433	20 568	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 2.35% 20 - 13.11.40	25 000	USD	21 290	17 486	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 3.20% 20 - 15.06.26	50 000	USD	50 451	48 539	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 3.40% 20 - 26.07.29	75 000	USD	75 908	71 194	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 3.45% 20 - 15.11.27	25 000	USD	25 376	24 279	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 3.70% 22 - 15.03.52	50 000	USD	49 743	39 336	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 4.125% 20 - 15.06.39	15 000	USD	13 965	13 569	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 4.25% 20 - 26.10.49	100 000	USD	107 317	87 035	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 5.00% 20 - 15.08.45	75 000	USD	86 649	74 534	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 6.25% 23 - 15.11.53	50 000	USD	54 648	57 421	0,01
Brixmor Operating Partnership LP 4.05% 20 - 01.07.30	50 000	USD	49 917	46 980	0,01
Broadcom Corp. / Broadcom Cayman Finance Ltd. 3.875% 18 - 15.01.27	100 000	USD	98 420	97 629	0,01
Broadcom Inc. 3.15% 20 - 15.11.25	20 000	USD	19 404	19 371	0,00
Broadcom Inc. 4.15% 20 - 15.11.30	80 000	USD	77 047	76 518	0,01
Broadridge Financial Solutions Inc. 2.60% 21 - 01.05.31	50 000	USD	46 109	42 789	0,01
Brown & Brown Inc. 4.95% 22 - 17.03.52	50 000	USD	42 313	44 376	0,01
Bunge Ltd. Finance Corp. 2.75% 21 - 14.05.31	65 000	USD	60 207	56 633	0,01
Camden Property Trust 2.80% 20 - 15.05.30	25 000	USD	24 157	22 469	0,00
Campbell Soup Co. 4.80% 18 - 15.03.48	25 000	USD	26 464	22 883	0,00
Capital One Financial Corp. FRN 21 - 29.07.32	80 000	USD	60 246	60 730	0,01
Capital One Financial Corp. FRN 22 - 01.03.30	50 000	USD	44 298	44 652	0,01
Capital One Financial Corp. 3.75% 16 - 28.07.26	200 000	USD	188 769	191 596	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Capital One Financial Corp. 4.20% 15 - 29.10.25	100 000	USD	97 971	98 191	0,01
Capital One Financial Corp. FRN 23 - 08.06.34	50 000	USD	50 531	51 621	0,01
Cardinal Health Inc. 3.41% 17 - 15.06.27	75 000	USD	75 301	72 050	0,01
Cargill Inc. 3.875% 23 - 24.04.30	100 000	EUR	111 354	114 621	0,02
Carlisle Cos Inc. 2.20% 21 - 01.03.32	50 000	USD	44 475	40 534	0,01
Carrier Global Corp. 2.493% 20 - 15.02.27	160 000	USD	150 942	150 677	0,02
Carrier Global Corp. 2.722% 20 - 15.02.30	50 000	USD	45 570	44 813	0,01
Carrier Global Corp. 3.377% 20 - 05.04.40	75 000	USD	68 207	60 359	0,01
Carrier Global Corp. 3.577% 20 - 05.04.50	25 000	USD	20 405	19 572	0,00
Caterpillar Financial Services Corp. 0.80% 20 - 13.11.25	25 000	USD	24 147	23 348	0,00
Caterpillar Financial Services Corp. 0.90% 21 - 02.03.26	25 000	USD	24 046	23 177	0,00
Caterpillar Financial Services Corp. 1.10% 20 - 14.09.27	25 000	USD	23 490	22 366	0,00
Caterpillar Financial Services Corp. 3.60% 22 - 12.08.27	100 000	USD	98 460	97 724	0,01
Caterpillar Financial Services Corp. 4.90% 22 - 17.01.25	75 000	USD	74 838	75 032	0,01
Caterpillar Inc. 2.60% 20 - 09.04.30	25 000	USD	24 411	22 770	0,00
Caterpillar Inc. 3.25% 19 - 19.09.49	50 000	USD	47 452	39 723	0,01
Caterpillar Inc. 3.803% 12 - 15.08.42	25 000	USD	25 427	22 025	0,00
Caterpillar Inc. 5.20% 11 - 27.05.41	25 000	USD	29 550	26 501	0,00
Cboe Global Markets Inc. 3.65% 17 - 12.01.27	25 000	USD	25 391	24 284	0,00
CDW LLC / CDW Finance Corp. 2.67% 21 - 01.12.26	75 000	USD	72 634	70 187	0,01
Cencora Inc. 3.45% 17 - 15.12.27	75 000	USD	75 038	72 198	0,01
Centene Corp. 2.625% 21 - 01.08.31	100 000	USD	79 958	83 468	0,01
Centene Corp. 4.25% 20 - 15.12.27	150 000	USD	140 968	144 898	0,02
CF Industries Inc. 5.15% 14 - 15.03.34	50 000	USD	45 956	49 620	0,01
Charles Schwab Corp. 1.15% 21 - 13.05.26	70 000	USD	67 311	64 147	0,01
Charles Schwab Corp. 1.65% 20 - 11.03.31	50 000	USD	44 614	40 269	0,01
Charles Schwab Corp. 1.95% 21 - 01.12.31	80 000	USD	62 476	64 464	0,01
Charles Schwab Corp. 2.00% 21 - 20.03.28	35 000	USD	33 440	31 178	0,01
Charles Schwab Corp. 2.90% 22 - 03.03.32	50 000	USD	41 216	43 137	0,01
Charles Schwab Corp. 3.20% 17 - 25.01.28	50 000	USD	46 054	47 259	0,01
Charles Schwab Corp. 3.85% 18 - 21.05.25	20 000	USD	20 245	19 642	0,00
Charles Schwab Corp. 4.625% 20 - 22.03.30	20 000	USD	21 382	20 093	0,00
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.25% 21 - 15.01.29	50 000	USD	41 309	43 423	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.80% 20 - 01.04.31	40 000	USD	31 531	33 822	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.70% 20 - 01.04.51	165 000	USD	104 839	107 643	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.75% 17 - 15.02.28	100 000	USD	90 879	94 519	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.85% 20 - 01.04.61	100 000	USD	53 105	62 893	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.90% 21 - 01.06.52	50 000	USD	30 317	33 844	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.95% 21 - 30.06.62	80 000	USD	52 112	50 926	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.20% 17 - 15.03.28	50 000	USD	46 156	48 058	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.80% 19 - 01.03.50	50 000	USD	33 159	39 037	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.908% 16 - 23.07.25	150 000	USD	147 145	148 608	0,02
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.375% 17 - 01.05.47	75 000	USD	62 298	64 078	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.75% 18 - 01.04.48	50 000	USD	38 013	44 557	0,01
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.484% 16 - 23.10.45	50 000	USD	43 962	49 371	0,01
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 2.742% 22 - 31.12.39	25 000	USD	22 267	19 949	0,00
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.125% 17 - 30.06.27	55 000	USD	57 339	55 270	0,01
Cheniere Energy Partners LP 4.00% 21 - 01.03.31	50 000	USD	44 518	45 492	0,01
Cheniere Energy Partners LP 4.50% 20 - 01.10.29	20 000	USD	18 588	19 127	0,00
Chubb Corp. 6.00% 07 - 11.05.37	30 000	USD	36 493	33 248	0,01
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.12.29	100 000	EUR	104 801	97 829	0,01
Chubb INA Holdings Inc. 1.375% 20 - 15.09.30	20 000	USD	17 883	16 505	0,00
Chubb INA Holdings Inc. 2.85% 21 - 15.12.51	15 000	USD	12 681	10 920	0,00
Chubb INA Holdings Inc. 3.05% 21 - 15.12.61	25 000	USD	20 875	17 997	0,00
Chubb INA Holdings Inc. 3.15% 15 - 15.03.25	15 000	USD	15 085	14 675	0,00
Chubb INA Holdings Inc. 3.35% 15 - 03.05.26	25 000	USD	25 240	24 305	0,00
Chubb INA Holdings Inc. 4.35% 15 - 03.11.45	35 000	USD	37 032	32 958	0,01
Cigna Corp. 2.375% 21 - 15.03.31	25 000	USD	23 175	21 369	0,00
Cigna Corp. 2.40% 20 - 15.03.30	125 000	USD	110 846	109 642	0,02
Cigna Corp. 3.40% 20 - 01.03.27	100 000	USD	95 939	96 451	0,01
Cigna Corp. 4.125% 19 - 15.11.25	100 000	USD	101 763	98 721	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Cigna Corp. 4.375% 19 - 15.10.28	75 000	USD	77 696	74 334	0,01
Cigna Corp. 4.80% 19 - 15.08.38	25 000	USD	26 853	24 221	0,00
Cigna Corp. 4.80% 20 - 15.07.46	25 000	USD	27 081	23 561	0,00
Cigna Corp. 4.90% 19 - 15.12.48	60 000	USD	65 946	57 082	0,01
Cintas Corp. No 2 3.70% 17 - 01.04.27	50 000	USD	50 922	48 895	0,01
Cisco Systems Inc. 2.50% 16 - 20.09.26	50 000	USD	49 815	47 711	0,01
Cisco Systems Inc. 5.50% 09 - 15.01.40	100 000	USD	122 444	106 766	0,02
Citigroup Inc. FRN 21 - 28.01.27	50 000	USD	44 743	45 975	0,01
Citigroup Inc. 1.25% 19 - 10.04.29	100 000	EUR	107 293	99 315	0,02
Citigroup Inc. FRN 21 - 09.06.27	230 000	USD	214 578	210 507	0,03
Citigroup Inc. FRN 18 - 24.07.26	100 000	EUR	110 378	106 656	0,02
Citigroup Inc. 1.75% 19 - 23.10.26	120 000	GBP	152 832	141 575	0,02
Citigroup Inc. 2.40% 05 - 31.10.25	20 000 000	JPY	169 584	145 494	0,02
Citigroup Inc. FRN 21 - 03.11.32	140 000	USD	127 275	115 678	0,02
Citigroup Inc. FRN 20 - 03.06.31	105 000	USD	97 440	89 824	0,01
Citigroup Inc. FRN 19 - 05.11.30	165 000	USD	157 920	147 012	0,02
Citigroup Inc. FRN 22 - 25.01.33	75 000	USD	71 107	64 073	0,01
Citigroup Inc. FRN 20 - 08.04.26	150 000	USD	148 153	145 858	0,02
Citigroup Inc. 3.20% 16 - 21.10.26	165 000	USD	164 116	157 415	0,02
Citigroup Inc. 3.30% 15 - 27.04.25	100 000	USD	100 267	97 720	0,01
Citigroup Inc. 3.40% 16 - 01.05.26	120 000	USD	116 241	115 860	0,02
Citigroup Inc. FRN 18 - 24.01.39	100 000	USD	99 376	86 492	0,01
Citigroup Inc. FRN 18 - 23.04.29	35 000	USD	35 413	33 746	0,01
Citigroup Inc. FRN 17 - 24.04.48	65 000	USD	68 478	56 988	0,01
Citigroup Inc. 4.40% 15 - 10.06.25	50 000	USD	48 567	49 435	0,01
Citigroup Inc. 4.65% 15 - 30.07.45	15 000	USD	13 878	13 675	0,00
Citigroup Inc. 4.65% 18 - 23.07.48	100 000	USD	97 361	92 479	0,01
Citigroup Inc. 4.75% 16 - 18.05.46	43 000	USD	45 178	38 667	0,01
Citigroup Inc. 5.30% 14 - 06.05.44	70 000	USD	72 610	67 567	0,01
Citigroup Inc. 5.50% 13 - 13.09.25	100 000	USD	99 685	100 532	0,02
Citigroup Inc. 5.875% 12 - 30.01.42	65 000	USD	67 893	69 397	0,01
Citigroup Inc. 6.675% 13 - 13.09.43	50 000	USD	56 526	56 293	0,01
Citizens Financial Group Inc. 2.85% 19 - 27.07.26	60 000	USD	59 593	55 897	0,01
Clorox Co. 3.90% 18 - 15.05.28	30 000	USD	30 537	29 099	0,00
CME Group Inc. 3.75% 18 - 15.06.28	30 000	USD	30 678	29 375	0,00
CME Group Inc. 5.30% 13 - 15.09.43	30 000	USD	35 692	32 013	0,01
CNH Industrial Capital LLC 1.875% 20 - 15.01.26	60 000	USD	58 291	56 291	0,01
Coca-Cola Co. 1.00% 20 - 15.03.28	50 000	USD	42 303	44 152	0,01
Coca-Cola Co. 1.45% 20 - 01.06.27	50 000	USD	47 953	45 707	0,01
Coca-Cola Co. 1.50% 21 - 05.03.28	50 000	USD	47 242	45 104	0,01
Coca-Cola Co. 1.625% 15 - 09.03.35	100 000	EUR	109 117	95 457	0,01
Coca-Cola Co. 1.65% 20 - 01.06.30	50 000	USD	45 767	42 867	0,01
Coca-Cola Co. 1.875% 14 - 22.09.26	100 000	EUR	113 413	107 169	0,02
Coca-Cola Co. 2.125% 19 - 06.09.29	25 000	USD	23 826	22 604	0,00
Coca-Cola Co. 2.25% 21 - 05.01.32	15 000	USD	14 063	13 101	0,00
Coca-Cola Co. 2.50% 20 - 01.06.40	50 000	USD	32 480	37 890	0,01
Coca-Cola Co. 2.75% 20 - 01.06.60	25 000	USD	21 065	17 448	0,00
Coca-Cola Co. 3.00% 21 - 05.03.51	80 000	USD	61 908	60 638	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Colgate-Palmolive Co. 0.30% 21 - 10.11.29	100 000	EUR	104 276	96 571	0,01
Colgate-Palmolive Co. 3.25% 22 - 15.08.32	60 000	USD	54 537	55 783	0,01
Colgate-Palmolive Co. 4.00% 15 - 15.08.45	25 000	USD	26 827	23 092	0,00
Comcast Corp. 1.50% 20 - 15.02.31	270 000	USD	221 356	221 492	0,03
Comcast Corp. 1.95% 20 - 15.01.31	200 000	USD	178 303	168 852	0,03
Comcast Corp. 2.887% 22 - 01.11.51	230 000	USD	166 641	156 089	0,02
Comcast Corp. 2.937% 22 - 01.11.56	150 000	USD	98 356	99 049	0,01
Comcast Corp. 2.987% 22 - 01.11.63	70 000	USD	40 591	45 347	0,01
Comcast Corp. 3.15% 16 - 01.03.26	75 000	USD	74 487	72 833	0,01
Comcast Corp. 3.95% 18 - 15.10.25	153 000	USD	151 023	151 040	0,02
Comcast Corp. 3.969% 17 - 01.11.47	50 000	USD	41 680	42 116	0,01
Comcast Corp. 4.15% 18 - 15.10.28	100 000	USD	101 228	98 715	0,01
Comcast Corp. 4.40% 15 - 15.08.35	200 000	USD	201 126	193 054	0,03
Comcast Corp. 4.65% 12 - 15.07.42	175 000	USD	166 979	165 112	0,02
Comerica Inc. 4.00% 19 - 01.02.29	50 000	USD	44 511	47 306	0,01
Commonwealth Edison Co. 3.00% 20 - 01.03.50	50 000	USD	35 590	35 009	0,01
Commonwealth Edison Co. 3.65% 16 - 15.06.46	70 000	USD	56 189	55 515	0,01
Conagra Brands Inc. 1.375% 20 - 01.11.27	25 000	USD	23 042	21 985	0,00
Conagra Brands Inc. 4.60% 18 - 01.11.25	25 000	USD	25 508	24 780	0,00
Conagra Brands Inc. 4.85% 18 - 01.11.28	25 000	USD	26 027	25 018	0,00
Conagra Brands Inc. 5.30% 18 - 01.11.38	25 000	USD	27 158	24 545	0,00
Conagra Brands Inc. 5.40% 18 - 01.11.48	25 000	USD	27 962	24 266	0,00
Connecticut Light and Power Co. 4.00% 18 - 01.04.48	50 000	USD	51 307	42 756	0,01
Costco Wholesale Corp. 1.375% 20 - 20.06.27	50 000	USD	47 677	45 424	0,01
Costco Wholesale Corp. 1.60% 20 - 20.04.30	25 000	USD	22 879	21 442	0,00
Costco Wholesale Corp. 1.75% 20 - 20.04.32	25 000	USD	22 552	20 835	0,00
Credit Suisse USA Inc. 7.125% 02 - 15.07.32	100 000	USD	99 895	114 154	0,02
Crown Castle Inc. 1.05% 21 - 15.07.26	50 000	USD	47 190	45 153	0,01
Crown Castle Inc. 2.10% 21 - 01.04.31	75 000	USD	66 637	61 170	0,01
Crown Castle Inc. 2.25% 20 - 15.01.31	70 000	USD	58 135	58 048	0,01
Crown Castle Inc. 2.90% 21 - 01.04.41	25 000	USD	20 838	17 886	0,00
Crown Castle Inc. 3.25% 20 - 15.01.51	25 000	USD	20 784	17 553	0,00
Crown Castle Inc. 3.30% 20 - 01.07.30	25 000	USD	24 074	22 460	0,00
Crown Castle Inc. 3.80% 18 - 15.02.28	50 000	USD	50 016	47 548	0,01
Crown Castle Inc. 4.45% 16 - 15.02.26	25 000	USD	25 458	24 633	0,00
CSX Corp. 2.50% 20 - 15.05.51	90 000	USD	72 056	58 480	0,01
CSX Corp. 3.80% 18 - 01.03.28	50 000	USD	51 083	49 081	0,01
CSX Corp. 4.25% 16 - 01.11.66	25 000	USD	25 346	21 412	0,00
CSX Corp. 4.25% 18 - 15.03.29	25 000	USD	26 067	24 994	0,00
CSX Corp. 4.50% 22 - 15.11.52	70 000	USD	65 120	65 239	0,01
CSX Corp. 5.50% 10 - 15.04.41	50 000	USD	58 338	52 291	0,01
Cummins Inc. 2.60% 20 - 01.09.50	50 000	USD	39 829	33 262	0,01
CVS Health Corp. 1.75% 20 - 21.08.30	25 000	USD	22 459	20 695	0,00
CVS Health Corp. 1.875% 20 - 28.02.31	50 000	USD	44 921	41 212	0,01
CVS Health Corp. 2.875% 16 - 01.06.26	50 000	USD	49 745	47 785	0,01
CVS Health Corp. 3.75% 20 - 01.04.30	50 000	USD	50 444	47 113	0,01
CVS Health Corp. 3.875% 15 - 20.07.25	50 000	USD	50 586	49 143	0,01
CVS Health Corp. 4.125% 20 - 01.04.40	75 000	USD	64 550	64 540	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
CVS Health Corp. 4.25% 20 - 01.04.50	50 000	USD	42 434	41 761	0,01
CVS Health Corp. 4.30% 18 - 25.03.28	120 000	USD	120 882	118 092	0,02
CVS Health Corp. 4.78% 18 - 25.03.38	75 000	USD	80 230	71 113	0,01
CVS Health Corp. 4.875% 15 - 20.07.35	100 000	USD	108 283	98 550	0,01
CVS Health Corp. 5.05% 18 - 25.03.48	100 000	USD	111 090	93 936	0,01
CVS Health Corp. 5.125% 15 - 20.07.45	100 000	USD	110 571	94 959	0,01
CVS Health Corp. 5.25% 23 - 21.02.33	100 000	USD	98 770	102 377	0,02
Danaher Corp. 2.10% 20 - 30.09.26	100 000	EUR	112 965	108 002	0,02
Deere & Co. 2.75% 20 - 15.04.25	30 000	USD	29 980	29 260	0,00
Deere & Co. 2.875% 19 - 07.09.49	30 000	USD	27 020	22 564	0,00
Deere & Co. 3.10% 20 - 15.04.30	15 000	USD	14 981	13 930	0,00
Deere & Co. 3.75% 20 - 15.04.50	60 000	USD	51 005	52 742	0,01
Deere & Co. 3.90% 12 - 09.06.42	30 000	USD	31 405	27 047	0,00
Dell International LLC / EMC Corp. 3.375% 23 - 15.12.41	25 000	USD	21 141	18 968	0,00
Dell International LLC / EMC Corp. 3.45% 23 - 15.12.51	25 000	USD	20 138	18 175	0,00
Dell International LLC / EMC Corp. 4.90% 21 - 01.10.26	100 000	USD	100 205	100 119	0,02
Dell International LLC / EMC Corp. 5.30% 21 - 01.10.29	25 000	USD	26 604	25 780	0,00
Dell International LLC / EMC Corp. 5.85% 21 - 15.07.25	25 000	USD	25 847	25 248	0,00
Dell International LLC / EMC Corp. 6.02% 21 - 15.06.26	60 000	USD	62 973	61 411	0,01
Dell International LLC / EMC Corp. 6.20% 21 - 15.07.30	25 000	USD	27 695	26 865	0,00
Dell International LLC / EMC Corp. 8.10% 21 - 15.07.36	25 000	USD	31 696	30 780	0,01
Dell International LLC / EMC Corp. 8.35% 21 - 15.07.46	25 000	USD	35 386	33 056	0,01
Dick's Sporting Goods Inc. 4.10% 22 - 15.01.52	50 000	USD	42 781	35 871	0,01
Digital Euro Finco LLC 2.50% 19 - 16.01.26	100 000	EUR	111 719	107 553	0,02
Digital Realty Trust LP 4.45% 18 - 15.07.28	50 000	USD	51 458	48 967	0,01
Discover Bank 4.65% 18 - 13.09.28	60 000	USD	61 544	57 274	0,01
Discover Financial Services 4.10% 17 - 09.02.27	50 000	USD	50 575	47 971	0,01
Discovery Communications LLC 3.625% 20 - 15.05.30	25 000	USD	24 318	22 711	0,00
Discovery Communications LLC 3.95% 17 - 20.03.28	25 000	USD	24 849	23 829	0,00
Discovery Communications LLC 4.125% 19 - 15.05.29	25 000	USD	25 025	23 730	0,00
Discovery Communications LLC 4.875% 13 - 01.04.43	75 000	USD	67 528	62 749	0,01
Discovery Communications LLC 5.00% 17 - 20.09.37	50 000	USD	48 069	44 876	0,01
Discovery Communications LLC 5.30% 19 - 15.05.49	75 000	USD	78 311	64 992	0,01
Discovery Communications LLC 6.35% 10 - 01.06.40	25 000	USD	28 205	25 146	0,00
Dollar General Corp. 3.875% 17 - 15.04.27	50 000	USD	50 982	48 514	0,01
Dollar General Corp. 4.125% 20 - 03.04.50	25 000	USD	24 612	19 861	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Dollar Tree Inc. 4.20% 18 - 15.05.28	75 000	USD	76 614	73 492	0,01
Dow Chemical Co. 2.10% 20 - 15.11.30	25 000	USD	22 931	21 438	0,00
Dow Chemical Co. 3.60% 20 - 15.11.50	50 000	USD	39 098	38 745	0,01
Dow Chemical Co. 6.30% 22 - 15.03.33	120 000	USD	129 936	132 485	0,02
Dow Chemical Co. 9.40% 09 - 15.05.39	50 000	USD	76 178	69 859	0,01
DR Horton Inc. 1.30% 21 - 15.10.26	40 000	USD	37 830	36 498	0,01
DuPont de Nemours Inc. 4.493% 18 - 15.11.25	80 000	USD	79 286	79 533	0,01
DuPont de Nemours Inc. 4.725% 18 - 15.11.28	50 000	USD	52 566	50 861	0,01
DuPont de Nemours Inc. 5.319% 18 - 15.11.38	45 000	USD	46 076	46 308	0,01
DuPont de Nemours Inc. 5.419% 18 - 15.11.48	50 000	USD	59 057	52 321	0,01
Eaton Corp. 3.103% 17 - 15.09.27	75 000	USD	75 082	71 847	0,01
Eaton Corp. 4.15% 22 - 15.03.33	65 000	USD	63 409	63 641	0,01
eBay Inc. 1.40% 21 - 10.05.26	25 000	USD	24 023	23 166	0,00
eBay Inc. 2.60% 21 - 10.05.31	25 000	USD	23 301	21 828	0,00
eBay Inc. 2.70% 20 - 11.03.30	25 000	USD	23 848	22 290	0,00
eBay Inc. 3.60% 17 - 05.06.27	25 000	USD	25 271	24 208	0,00
eBay Inc. 3.65% 21 - 10.05.51	25 000	USD	22 617	19 167	0,00
eBay Inc. 4.00% 12 - 15.07.42	25 000	USD	24 220	20 872	0,00
Ecolab Inc. 2.125% 21 - 01.02.32	25 000	USD	23 147	21 340	0,00
Ecolab Inc. 2.70% 16 - 01.11.26	25 000	USD	24 873	23 954	0,00
Ecolab Inc. 2.70% 21 - 15.12.51	25 000	USD	21 184	17 126	0,00
Ecolab Inc. 2.75% 21 - 18.08.55	25 000	USD	20 727	16 870	0,00
Ecolab Inc. 4.80% 20 - 24.03.30	25 000	USD	26 999	25 716	0,00
Electronic Arts Inc. 1.85% 21 - 15.02.31	25 000	USD	22 508	20 902	0,00
Electronic Arts Inc. 2.95% 21 - 15.02.51	25 000	USD	20 742	17 729	0,00
Elevance Health Inc. 1.50% 21 - 15.03.26	25 000	USD	24 194	23 298	0,00
Elevance Health Inc. 2.25% 20 - 15.05.30	25 000	USD	23 283	21 684	0,00
Elevance Health Inc. 2.375% 19 - 15.01.25	75 000	USD	74 694	72 883	0,01
Elevance Health Inc. 2.55% 21 - 15.03.31	25 000	USD	23 586	21 692	0,00
Elevance Health Inc. 2.875% 19 - 15.09.29	25 000	USD	24 308	22 945	0,00
Elevance Health Inc. 3.60% 21 - 15.03.51	105 000	USD	98 977	82 607	0,01
Elevance Health Inc. 3.65% 17 - 01.12.27	50 000	USD	50 731	48 478	0,01
Elevance Health Inc. 4.625% 12 - 15.05.42	100 000	USD	106 777	93 479	0,01
Eli Lilly & Co. 0.50% 21 - 14.09.33	100 000	EUR	100 554	89 956	0,01
Eli Lilly & Co. 2.50% 20 - 15.09.60	18 000	USD	14 390	11 381	0,00
Eli Lilly & Co. 3.375% 19 - 15.03.29	25 000	USD	25 460	24 070	0,00
Eli Lilly & Co. 4.875% 23 - 27.02.53	100 000	USD	103 062	103 936	0,02
Emerson Electric Co. 2.20% 21 - 21.12.31	100 000	USD	92 889	85 612	0,01
Enterprise Products Operating LLC 2.80% 20 - 31.01.30	100 000	USD	96 555	90 674	0,01
Enterprise Products Operating LLC 3.30% 21 - 15.02.53	100 000	USD	85 511	74 402	0,01
Enterprise Products Operating LLC 4.25% 18 - 15.02.48	75 000	USD	74 294	66 247	0,01
Enterprise Products Operating LLC 5.10% 14 - 15.02.45	100 000	USD	107 851	98 619	0,01
Enterprise Products Operating LLC FRN 18 - 15.02.78	70 000	USD	58 646	62 800	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Enterprise Products Operating LLC 6.45% 10 - 01.09.40	50 000	USD	60 545	56 713	0,01
Equifax Inc. 2.35% 21 - 15.09.31	25 000	USD	22 619	20 816	0,00
Equinix Inc. 2.15% 20 - 15.07.30	25 000	USD	22 495	21 237	0,00
Equinix Inc. 2.50% 21 - 15.05.31	25 000	USD	22 778	21 287	0,00
Equinix Inc. 2.95% 20 - 15.09.51	50 000	USD	39 701	33 499	0,01
Equinix Inc. 3.20% 19 - 18.11.29	25 000	USD	24 060	23 014	0,00
Equitable Holdings Inc. 4.35% 19 - 20.04.28	30 000	USD	30 587	29 019	0,00
Equitable Holdings Inc. 5.00% 19 - 20.04.48	50 000	USD	53 158	46 669	0,01
Essential Utilities Inc. 3.351% 20 - 15.04.50	25 000	USD	21 984	17 843	0,00
Estee Lauder Cos Inc. 1.95% 21 - 15.03.31	75 000	USD	69 052	62 875	0,01
Estee Lauder Cos Inc. 2.60% 20 - 15.04.30	50 000	USD	44 517	44 381	0,01
Exelon Corp. 2.75% 23 - 15.03.27	40 000	USD	37 190	37 685	0,01
Exelon Corp. 3.95% 16 - 15.06.25	50 000	USD	49 048	49 163	0,01
Exelon Corp. 4.10% 23 - 15.03.52	100 000	USD	90 308	81 499	0,01
Exelon Corp. 4.45% 16 - 15.04.46	15 000	USD	14 307	13 087	0,00
Exelon Corp. 5.15% 23 - 15.03.28	60 000	USD	60 380	60 941	0,01
Exelon Corp. 5.30% 23 - 15.03.33	72 000	USD	72 039	73 650	0,01
Exelon Corp. 5.625% 05 - 15.06.35	25 000	USD	26 843	25 819	0,00
Federal National Mortgage Association 0.50% 20 - 17.06.25	225 000	USD	213 597	212 319	0,03
Federal National Mortgage Association 0.50% 20 - 07.11.25	100 000	USD	92 546	93 193	0,01
Federal National Mortgage Association 0.75% 20 - 08.10.27	300 000	USD	282 194	266 529	0,04
Federal National Mortgage Association 0.875% 20 - 05.08.30	250 000	USD	224 703	204 245	0,03
Federal National Mortgage Association 1.625% 20 - 07.01.25	300 000	USD	297 838	290 712	0,04
Federal National Mortgage Association 1.875% 16 - 24.09.26	300 000	USD	285 893	283 293	0,04
Federal National Mortgage Association 5.625% 07 - 15.07.37	50 000	USD	58 759	57 096	0,01
Federal National Mortgage Association 6.25% 99 - 15.05.29	150 000	USD	168 759	166 596	0,02
Federal National Mortgage Association 6.625% 00 - 15.11.30	30 000	USD	34 679	34 547	0,01
Federal National Mortgage Association 7.125% 00 - 15.01.30	100 000	USD	113 527	116 424	0,02
Federal Realty Investment Trust 4.50% 14 - 01.12.44	25 000	USD	25 137	20 977	0,00
FedEx Corp. 0.45% 21 - 04.05.29	100 000	EUR	99 218	96 012	0,01
FedEx Corp. 2.40% 21 - 15.05.31	25 000	USD	23 192	21 523	0,00
FedEx Corp. 3.10% 19 - 05.08.29	25 000	USD	24 615	23 162	0,00
FedEx Corp. 3.25% 16 - 01.04.26	25 000	USD	25 197	24 189	0,00
FedEx Corp. 3.25% 21 - 15.05.41	25 000	USD	22 396	19 381	0,00
FedEx Corp. 4.25% 20 - 15.05.30	25 000	USD	25 826	24 474	0,00
FedEx Corp. 4.55% 16 - 01.04.46	25 000	USD	25 756	22 440	0,00
FedEx Corp. 5.10% 14 - 15.01.44	90 000	USD	85 481	87 223	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
FedEx Corp. 5.25% 20 - 15.05.50	80 000	USD	68 413	79 822	0,01
Fidelity National Information Services Inc. 1.15% 21 - 01.03.26	75 000	USD	71 638	69 338	0,01
Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 19 - 21.05.27	100 000	EUR	109 730	104 550	0,02
Fidelity National Information Services Inc. 3.10% 21 - 01.03.41	50 000	USD	43 252	37 356	0,01
Fifth Third Bancorp 8.25% 08 - 01.03.38	50 000	USD	70 956	59 300	0,01
Fifth Third Bank NA 2.25% 20 - 01.02.27	50 000	USD	48 929	46 102	0,01
Fifth Third Bank NA 3.95% 18 - 28.07.25	50 000	USD	50 775	48 921	0,01
First American Financial Corp. 2.40% 21 - 15.08.31	30 000	USD	26 889	23 729	0,00
Fiserv Inc. 2.25% 20 - 01.06.27	25 000	USD	24 102	23 166	0,00
Fiserv Inc. 2.65% 20 - 01.06.30	25 000	USD	23 349	22 053	0,00
Fiserv Inc. 3.20% 19 - 01.07.26	25 000	USD	24 974	24 070	0,00
Fiserv Inc. 3.50% 19 - 01.07.29	50 000	USD	49 091	47 137	0,01
Fiserv Inc. 3.85% 15 - 01.06.25	25 000	USD	25 215	24 555	0,00
Fiserv Inc. 4.20% 18 - 01.10.28	25 000	USD	25 529	24 495	0,00
Fiserv Inc. 4.40% 19 - 01.07.49	100 000	USD	89 023	88 239	0,01
FMC Corp. 3.45% 19 - 01.10.29	30 000	USD	29 520	27 440	0,00
Fortive Corp. 4.30% 17 - 15.06.46	25 000	USD	25 959	21 262	0,00
Fortune Brands Innovations Inc. 3.25% 19 - 15.09.29	25 000	USD	24 394	23 140	0,00
Fox Corp. 3.50% 20 - 08.04.30	25 000	USD	24 818	23 100	0,00
Fox Corp. 4.709% 20 - 25.01.29	50 000	USD	49 284	49 775	0,01
Fox Corp. 5.476% 20 - 25.01.39	50 000	USD	55 486	48 771	0,01
GATX Corp. 3.10% 21 - 01.06.51	25 000	USD	20 549	16 540	0,00
GE HealthCare Technologies Inc. 5.65% 23 - 15.11.27	100 000	USD	101 127	103 621	0,02
GE HealthCare Technologies Inc. 5.905% 23 - 22.11.32	100 000	USD	103 303	106 737	0,02
General Electric Co. 1.50% 17 - 17.05.29	100 000	EUR	98 925	102 262	0,02
General Electric Co. 5.875% 08 - 14.01.38	60 000	USD	64 354	66 134	0,01
General Mills Inc. 2.875% 20 - 15.04.30	25 000	USD	24 108	22 612	0,00
General Mills Inc. 3.00% 21 - 01.02.51	25 000	USD	21 438	17 483	0,00
General Mills Inc. 3.20% 17 - 10.02.27	25 000	USD	24 935	23 948	0,00
General Mills Inc. 4.00% 18 - 17.04.25	25 000	USD	25 279	24 675	0,00
General Mills Inc. 4.20% 18 - 17.04.28	25 000	USD	25 748	24 649	0,00
General Motors Co. 5.00% 14 - 01.04.35	100 000	USD	89 950	95 685	0,01
General Motors Co. 5.40% 17 - 01.04.48	160 000	USD	139 804	146 832	0,02
General Motors Co. 5.95% 18 - 01.04.49	50 000	USD	49 428	49 134	0,01
General Motors Financial Co. Inc. 0.65% 21 - 07.09.28	100 000	EUR	87 951	97 169	0,01
General Motors Financial Co. Inc. 2.40% 21 - 15.10.28	50 000	USD	43 640	44 449	0,01
General Motors Financial Co. Inc. 2.75% 20 - 20.06.25	20 000	USD	19 287	19 252	0,00
General Motors Financial Co. Inc. 2.90% 20 - 26.02.25	50 000	USD	48 704	48 530	0,01
General Motors Financial Co. Inc. 3.10% 22 - 12.01.32	120 000	USD	99 271	102 384	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Motors Financial Co. Inc. 4.00% 15 - 15.01.25	50 000	USD	49 450	49 183	0,01
General Motors Financial Co. Inc. 4.00% 16 - 06.10.26	100 000	USD	95 795	97 342	0,01
General Motors Financial Co. Inc. 4.35% 17 - 17.01.27	50 000	USD	48 563	49 055	0,01
General Motors Financial Co. Inc. 5.25% 16 - 01.03.26	80 000	USD	80 086	80 078	0,01
Gilead Sciences Inc. 1.20% 20 - 01.10.27	25 000	USD	23 291	22 267	0,00
Gilead Sciences Inc. 1.65% 20 - 01.10.30	25 000	USD	22 556	20 970	0,00
Gilead Sciences Inc. 2.80% 20 - 01.10.50	25 000	USD	20 456	17 306	0,00
Gilead Sciences Inc. 2.95% 16 - 01.03.27	25 000	USD	24 869	23 821	0,00
Gilead Sciences Inc. 3.50% 14 - 01.02.25	25 000	USD	25 144	24 610	0,00
Gilead Sciences Inc. 3.65% 15 - 01.03.26	25 000	USD	25 253	24 472	0,00
Gilead Sciences Inc. 4.00% 16 - 01.09.36	50 000	USD	50 737	46 071	0,01
Gilead Sciences Inc. 4.50% 14 - 01.02.45	100 000	USD	104 210	92 772	0,01
Gilead Sciences Inc. 4.60% 15 - 01.09.35	110 000	USD	108 986	108 733	0,02
Gilead Sciences Inc. 5.65% 11 - 01.12.41	50 000	USD	59 176	53 526	0,01
GlaxoSmithKline Capital Inc. 3.625% 18 - 15.05.25	25 000	USD	25 295	24 584	0,00
GlaxoSmithKline Capital Inc. 3.875% 18 - 15.05.28	25 000	USD	25 716	24 682	0,00
GlaxoSmithKline Capital Inc. 6.375% 08 - 15.05.38	75 000	USD	96 436	87 296	0,01
Global Payments Inc. 2.65% 19 - 15.02.25	100 000	USD	96 917	96 902	0,01
Global Payments Inc. 3.20% 19 - 15.08.29	50 000	USD	43 231	45 356	0,01
Global Payments Inc. 4.875% 23 - 17.03.31	100 000	EUR	108 681	115 903	0,02
Goldman Sachs Group Inc. FRN 21 - 12.02.26	170 000	USD	164 018	161 158	0,02
Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 21 - 18.03.33	100 000	EUR	98 795	87 747	0,01
Goldman Sachs Group Inc. FRN 20 - 09.12.26	95 000	USD	89 954	87 561	0,01
Goldman Sachs Group Inc. FRN 21 - 10.09.27	150 000	USD	134 472	136 116	0,02
Goldman Sachs Group Inc. 1.875% 21 - 16.12.30	100 000	GBP	121 049	106 247	0,02
Goldman Sachs Group Inc. FRN 21 - 28.02.29	40 000	CAD	25 417	27 311	0,00
Goldman Sachs Group Inc. FRN 21 - 21.07.32	150 000	USD	123 644	123 223	0,02
Goldman Sachs Group Inc. 2.60% 20 - 07.02.30	35 000	USD	32 818	30 774	0,01
Goldman Sachs Group Inc. FRN 22 - 24.02.28	75 000	USD	70 905	69 519	0,01
Goldman Sachs Group Inc. FRN 22 - 24.02.33	225 000	USD	213 110	193 428	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 3.375% 20 - 27.03.25	100 000	EUR	113 045	110 240	0,02
Goldman Sachs Group Inc. 3.50% 20 - 01.04.25	140 000	USD	138 491	136 990	0,02
Goldman Sachs Group Inc. FRN 22 - 29.10.29	50 000	GBP	48 337	60 286	0,01
Goldman Sachs Group Inc. FRN 17 - 05.06.28	150 000	USD	150 010	143 517	0,02
Goldman Sachs Group Inc. FRN 18 - 23.04.29	160 000	USD	160 231	151 976	0,02
Goldman Sachs Group Inc. 4.00% 22 - 21.09.29	100 000	EUR	96 012	113 989	0,02
Goldman Sachs Group Inc. 4.25% 15 - 21.10.25	100 000	USD	98 886	98 160	0,01
Goldman Sachs Group Inc. 4.75% 15 - 21.10.45	100 000	USD	80 255	95 233	0,01
Goldman Sachs Group Inc. 4.80% 14 - 08.07.44	160 000	USD	160 320	151 814	0,02
Goldman Sachs Group Inc. 6.75% 07 - 01.10.37	150 000	USD	182 795	165 693	0,02
Halliburton Co. 2.92% 20 - 01.03.30	100 000	USD	89 799	90 093	0,01
Halliburton Co. 4.85% 15 - 15.11.35	50 000	USD	49 390	49 346	0,01
Halliburton Co. 5.00% 15 - 15.11.45	50 000	USD	46 874	48 530	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Hartford Financial Services Group Inc. 4.40% 18 - 15.03.48	50 000	USD	50 914	43 921	0,01
Hasbro Inc. 3.90% 19 - 19.11.29	60 000	USD	60 118	55 940	0,01
HCA Inc. 2.375% 21 - 15.07.31	25 000	USD	22 612	20 719	0,00
HCA Inc. 3.50% 21 - 15.07.51	90 000	USD	63 513	63 457	0,01
HCA Inc. 4.125% 19 - 15.06.29	40 000	USD	40 343	38 306	0,01
HCA Inc. 4.50% 16 - 15.02.27	25 000	USD	25 497	24 664	0,00
HCA Inc. 4.625% 23 - 15.03.52	45 000	USD	44 967	38 488	0,01
HCA Inc. 5.125% 19 - 15.06.39	25 000	USD	26 668	23 818	0,00
HCA Inc. 5.25% 16 - 15.06.26	50 000	USD	51 602	50 204	0,01
HCA Inc. 5.25% 19 - 15.06.49	75 000	USD	80 446	69 889	0,01
HCA Inc. 5.375% 15 - 01.02.25	150 000	USD	151 426	149 926	0,02
HCA Inc. 5.50% 17 - 15.06.47	35 000	USD	38 588	33 760	0,01
HCA Inc. 5.50% 23 - 01.06.33	80 000	USD	79 974	81 381	0,01
Healthpeak Properties Inc. 2.875% 20 - 15.01.31	60 000	USD	57 222	52 057	0,01
Hershey Co. 2.30% 16 - 15.08.26	25 000	USD	24 708	23 728	0,00
Hewlett Packard Enterprise Co. 1.75% 20 - 01.04.26	25 000	USD	24 122	23 291	0,00
Hewlett Packard Enterprise Co. 4.90% 16 - 15.10.25	50 000	USD	51 230	49 812	0,01
Hewlett Packard Enterprise Co. 6.20% 16 - 15.10.35	25 000	USD	28 268	27 527	0,00
Hewlett Packard Enterprise Co. 6.35% 16 - 15.10.45	25 000	USD	28 162	27 094	0,00
HF Sinclair Corp. 5.875% 22 - 01.04.26	25 000	USD	25 805	25 267	0,00
Home Depot Inc. 1.375% 21 - 15.03.31	50 000	USD	44 355	40 916	0,01
Home Depot Inc. 1.50% 21 - 15.09.28	50 000	USD	46 689	44 370	0,01
Home Depot Inc. 2.125% 16 - 15.09.26	75 000	USD	73 796	70 631	0,01
Home Depot Inc. 2.50% 20 - 15.04.27	50 000	USD	49 398	47 196	0,01
Home Depot Inc. 2.70% 20 - 15.04.30	25 000	USD	24 338	22 798	0,00
Home Depot Inc. 2.75% 21 - 15.09.51	125 000	USD	107 042	85 921	0,01
Home Depot Inc. 2.95% 19 - 15.06.29	25 000	USD	24 798	23 549	0,00
Home Depot Inc. 3.00% 16 - 01.04.26	50 000	USD	50 243	48 494	0,01
Home Depot Inc. 3.30% 20 - 15.04.40	50 000	USD	48 051	41 520	0,01
Home Depot Inc. 3.50% 16 - 15.09.56	25 000	USD	23 850	19 783	0,00
Home Depot Inc. 3.625% 22 - 15.04.52	121 000	USD	96 764	98 466	0,01
Home Depot Inc. 4.25% 15 - 01.04.46	31 000	USD	33 003	28 133	0,00
Home Depot Inc. 5.875% 06 - 16.12.36	75 000	USD	92 379	84 012	0,01
Hormel Foods Corp. 1.70% 21 - 03.06.28	25 000	USD	23 569	22 525	0,00
Hormel Foods Corp. 1.80% 20 - 11.06.30	25 000	USD	22 851	21 282	0,00
Hormel Foods Corp. 3.05% 21 - 03.06.51	25 000	USD	22 188	18 108	0,00
Host Hotels & Resorts LP 3.375% 19 - 15.12.29	35 000	USD	33 587	31 506	0,01
Howmet Aerospace Inc. 5.95% 07 - 01.02.37	50 000	USD	52 491	52 306	0,01
Howmet Aerospace Inc. 6.875% 20 - 01.05.25	50 000	USD	50 888	50 712	0,01
HP Inc. 1.45% 22 - 17.06.26	25 000	USD	23 056	23 024	0,00
HP Inc. 2.20% 20 - 17.06.25	50 000	USD	49 270	47 920	0,01
HP Inc. 2.65% 22 - 17.06.31	30 000	USD	27 598	25 618	0,00
HP Inc. 6.00% 11 - 15.09.41	30 000	USD	34 237	31 737	0,01
Humana Inc. 1.35% 21 - 03.02.27	25 000	USD	23 503	22 579	0,00
Humana Inc. 2.15% 21 - 03.02.32	25 000	USD	22 404	20 609	0,00
Humana Inc. 4.50% 20 - 01.04.25	25 000	USD	25 386	24 806	0,00
Humana Inc. 4.95% 14 - 01.10.44	25 000	USD	27 537	23 761	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Humana Inc. 5.50% 23 - 15.03.53	50 000	USD	50 290	51 932	0,01
Huntington Bancshares Inc. 4.00% 18 - 15.05.25	60 000	USD	60 626	58 837	0,01
Illinois Tool Works Inc. 2.125% 15 - 22.05.30	100 000	EUR	114 069	105 842	0,02
Illinois Tool Works Inc. 3.90% 12 - 01.09.42	75 000	USD	76 486	67 341	0,01
Ingredion Inc. 2.90% 20 - 01.06.30	25 000	USD	23 747	22 328	0,00
Intel Corp. 1.60% 21 - 12.08.28	25 000	USD	23 463	22 136	0,00
Intel Corp. 2.45% 19 - 15.11.29	50 000	USD	48 144	45 082	0,01
Intel Corp. 2.60% 16 - 19.05.26	25 000	USD	24 919	23 937	0,00
Intel Corp. 3.70% 15 - 29.07.25	75 000	USD	75 944	73 831	0,01
Intel Corp. 3.734% 18 - 08.12.47	100 000	USD	74 899	81 761	0,01
Intel Corp. 3.75% 20 - 25.03.27	50 000	USD	51 176	49 050	0,01
Intel Corp. 4.75% 20 - 25.03.50	100 000	USD	113 824	95 046	0,01
Intel Corp. 4.875% 23 - 10.02.26	90 000	USD	91 177	90 685	0,01
Intel Corp. 4.90% 15 - 29.07.45	80 000	USD	91 331	81 050	0,01
Intel Corp. 4.90% 22 - 05.08.52	120 000	USD	111 644	117 715	0,02
Intel Corp. 4.95% 20 - 25.03.60	50 000	USD	59 229	49 625	0,01
Intel Corp. 5.20% 23 - 10.02.33	80 000	USD	78 671	83 694	0,01
Intel Corp. 5.70% 23 - 10.02.53	30 000	USD	30 660	32 545	0,01
Intercontinental Exchange Inc. 1.85% 20 - 15.09.32	35 000	USD	30 916	28 124	0,00
Intercontinental Exchange Inc. 2.10% 20 - 15.06.30	25 000	USD	23 232	21 628	0,00
Intercontinental Exchange Inc. 2.65% 20 - 15.09.40	30 000	USD	25 708	22 444	0,00
Intercontinental Exchange Inc. 3.00% 20 - 15.09.60	35 000	USD	28 332	23 784	0,00
Intercontinental Exchange Inc. 3.10% 17 - 15.09.27	10 000	USD	9 976	9 534	0,00
Intercontinental Exchange Inc. 3.65% 22 - 23.05.25	130 000	USD	128 914	127 559	0,02
Intercontinental Exchange Inc. 3.75% 18 - 21.09.28	10 000	USD	10 178	9 728	0,00
Intercontinental Exchange Inc. 4.25% 18 - 21.09.48	25 000	USD	26 283	22 514	0,00
Intercontinental Exchange Inc. 4.95% 22 - 15.06.52	35 000	USD	34 750	35 109	0,01
Intercontinental Exchange Inc. 5.20% 22 - 15.06.62	50 000	USD	50 368	51 343	0,01
International Business Machines Corp. 0.65% 20 - 11.02.32	100 000	EUR	102 450	91 331	0,01
International Business Machines Corp. 0.95% 17 - 23.05.25	100 000	EUR	110 365	106 808	0,02
International Business Machines Corp. 3.30% 19 - 15.05.26	30 000	USD	30 237	29 111	0,00
International Business Machines Corp. 3.375% 23 - 06.02.27	100 000	EUR	107 697	111 793	0,02
International Business Machines Corp. 3.45% 16 - 19.02.26	100 000	USD	99 075	97 465	0,01
International Business Machines Corp. 3.50% 19 - 15.05.29	100 000	USD	101 248	95 447	0,01
International Business Machines Corp. 4.00% 12 - 20.06.42	25 000	USD	25 265	21 867	0,00
International Business Machines Corp. 4.25% 19 - 15.05.49	100 000	USD	105 084	87 924	0,01
International Business Machines Corp. 5.10% 23 - 06.02.53	100 000	USD	95 240	100 410	0,02
International Business Machines Corp. 5.875% 02 - 29.11.32	25 000	USD	29 211	27 399	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Paper Co. 4.35% 17 - 15.08.48	30 000	USD	30 976	26 982	0,00
International Paper Co. 4.80% 14 - 15.06.44	75 000	USD	72 977	69 003	0,01
Interpublic Group of Cos Inc. 4.75% 20 - 30.03.30	60 000	USD	60 717	59 059	0,01
Intuit Inc. 1.35% 20 - 15.07.27	50 000	USD	47 048	45 125	0,01
Intuit Inc. 5.20% 23 - 15.09.33	100 000	USD	104 568	104 956	0,02
J M Smucker Co. 3.50% 15 - 15.03.25	25 000	USD	25 146	24 527	0,00
J M Smucker Co. 4.25% 15 - 15.03.35	25 000	USD	25 394	23 289	0,00
J M Smucker Co. 4.375% 15 - 15.03.45	25 000	USD	25 169	22 173	0,00
Jabil Inc. 3.95% 18 - 12.01.28	50 000	USD	50 183	47 734	0,01
John Deere Capital Corp. 0.70% 21 - 15.01.26	35 000	USD	33 572	32 457	0,01
John Deere Capital Corp. 1.45% 21 - 15.01.31	20 000	USD	17 970	16 464	0,00
John Deere Capital Corp. 1.50% 21 - 06.03.28	10 000	USD	9 430	8 926	0,00
John Deere Capital Corp. 1.75% 20 - 09.03.27	20 000	USD	19 311	18 428	0,00
John Deere Capital Corp. 2.05% 20 - 09.01.25	180 000	USD	175 628	175 025	0,03
John Deere Capital Corp. 2.80% 19 - 18.07.29	40 000	USD	39 463	37 143	0,01
Johnson & Johnson 0.95% 20 - 01.09.27	50 000	USD	47 054	44 674	0,01
Johnson & Johnson 1.15% 16 - 20.11.28	100 000	EUR	105 338	103 949	0,02
Johnson & Johnson 1.30% 20 - 01.09.30	100 000	USD	89 691	84 047	0,01
Johnson & Johnson 2.10% 20 - 01.09.40	25 000	USD	21 069	17 860	0,00
Johnson & Johnson 2.45% 20 - 01.09.60	25 000	USD	20 158	16 093	0,00
Johnson & Johnson 2.95% 17 - 03.03.27	25 000	USD	25 186	24 165	0,00
Johnson & Johnson 3.50% 17 - 15.01.48	50 000	USD	50 476	42 225	0,01
Johnson & Johnson 3.70% 16 - 01.03.46	75 000	USD	77 502	65 704	0,01
Johnson & Johnson 4.375% 13 - 05.12.33	75 000	USD	82 454	77 083	0,01
Johnson & Johnson 5.95% 07 - 15.08.37	20 000	USD	23 186	23 119	0,00
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 25.07.31	100 000	EUR	105 569	94 255	0,01
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 04.11.32	100 000	EUR	102 819	92 443	0,01
JPMorgan Chase & Co. FRN 21 - 22.04.27	215 000	USD	205 179	198 462	0,03
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 19.11.31	75 000	USD	66 489	60 874	0,01
JPMorgan Chase & Co. FRN 21 - 05.03.28	100 000	CAD	75 000	70 137	0,01
JPMorgan Chase & Co. FRN 21 - 01.06.29	150 000	USD	140 724	133 129	0,02
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 01.06.28	130 000	USD	124 259	118 882	0,02
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 22.04.31	150 000	USD	131 810	129 936	0,02
JPMorgan Chase & Co. FRN 21 - 22.04.32	150 000	USD	127 466	127 101	0,02
JPMorgan Chase & Co. FRN 22 - 24.02.26	200 000	USD	193 740	193 720	0,03
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 15.10.30	150 000	USD	143 143	133 434	0,02
JPMorgan Chase & Co. 2.95% 16 - 01.10.26	190 000	USD	180 219	181 237	0,03
JPMorgan Chase & Co. FRN 22 - 25.01.33	100 000	USD	86 238	85 795	0,01
JPMorgan Chase & Co. 3.00% 14 - 19.02.26	100 000	EUR	114 371	109 702	0,02
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 22.04.41	50 000	USD	45 580	38 706	0,01
JPMorgan Chase & Co. FRN 21 - 22.04.52	150 000	USD	128 828	112 651	0,02
JPMorgan Chase & Co. FRN 18 - 23.01.29	115 000	USD	110 290	108 984	0,02
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 24.07.38	130 000	USD	115 992	115 548	0,02
JPMorgan Chase & Co. 3.90% 15 - 15.07.25	180 000	USD	176 615	177 386	0,03
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 15.11.48	175 000	USD	156 343	147 402	0,02
JPMorgan Chase & Co. FRN 22 - 26.04.26	100 000	USD	97 940	98 409	0,01
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 22.02.48	50 000	USD	42 544	44 406	0,01
JPMorgan Chase & Co. FRN 22 - 25.07.33	250 000	USD	247 004	247 515	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
JPMorgan Chase & Co. 5.60% 11 - 15.07.41	160 000	USD	166 559	170 378	0,03
JPMorgan Chase & Co. FRN 22 - 14.09.33	150 000	USD	138 857	155 491	0,02
Kellanova 3.25% 16 - 01.04.26	25 000	USD	25 068	24 215	0,00
Kellogg Co. 4.50% 16 - 01.04.46	25 000	USD	26 419	22 471	0,00
Kenvue Inc. 5.00% 23 - 22.03.30	100 000	USD	100 619	103 447	0,02
Kenvue Inc. 5.05% 23 - 22.03.53	50 000	USD	47 923	51 868	0,01
Keurig Dr Pepper Inc. 3.20% 20 - 01.05.30	25 000	USD	24 376	23 012	0,00
Keurig Dr Pepper Inc. 4.417% 19 - 25.05.25	6 000	USD	6 083	5 940	0,00
Keurig Dr Pepper Inc. 4.50% 15 - 15.11.45	25 000	USD	25 343	22 728	0,00
Keurig Dr Pepper Inc. 4.50% 22 - 15.04.52	80 000	USD	74 433	73 219	0,01
KeyBank NA 3.30% 15 - 01.06.25	100 000	USD	98 189	96 235	0,01
KeyCorp 2.55% 19 - 01.10.29	50 000	USD	47 705	42 542	0,01
Keysight Technologies Inc. 4.60% 17 - 06.04.27	25 000	USD	25 853	24 935	0,00
Kimberly-Clark Corp. 3.20% 16 - 30.07.46	50 000	USD	46 411	38 353	0,01
Kimberly-Clark Corp. 3.95% 18 - 01.11.28	60 000	USD	62 225	59 171	0,01
Kimco Realty Corp. 4.25% 15 - 01.04.45	40 000	USD	39 405	32 548	0,01
Kimco Realty OP LLC 3.30% 17 - 01.02.25	50 000	USD	48 693	48 883	0,01
KLA Corp. 3.30% 20 - 01.03.50	25 000	USD	22 954	19 177	0,00
KLA Corp. 4.10% 19 - 15.03.29	25 000	USD	25 726	24 908	0,00
KLA Corp. 4.95% 22 - 15.07.52	80 000	USD	73 095	80 884	0,01
Kraft Heinz Foods Co. 3.00% 16 - 01.06.26	55 000	USD	54 471	52 876	0,01
Kraft Heinz Foods Co. 3.75% 21 - 01.04.30	25 000	USD	24 918	23 878	0,00
Kraft Heinz Foods Co. 4.375% 16 - 01.06.46	60 000	USD	48 083	52 591	0,01
Kraft Heinz Foods Co. 4.875% 21 - 01.10.49	20 000	USD	20 669	18 965	0,00
Kraft Heinz Foods Co. 5.20% 16 - 15.07.45	30 000	USD	31 738	29 466	0,00
Kraft Heinz Foods Co. 6.875% 13 - 26.01.39	50 000	USD	56 530	57 885	0,01
Kroger Co. 2.65% 16 - 15.10.26	50 000	USD	46 567	47 296	0,01
Kroger Co. 3.70% 17 - 01.08.27	50 000	USD	50 726	48 482	0,01
Kroger Co. 3.95% 20 - 15.01.50	25 000	USD	24 710	20 486	0,00
Kroger Co. 4.45% 17 - 01.02.47	40 000	USD	41 693	35 468	0,01
Laboratory Corp. of America Holdings 2.70% 21 - 01.06.31	50 000	USD	44 962	43 031	0,01
Laboratory Corp. of America Holdings 3.60% 15 - 01.02.25	50 000	USD	50 241	49 153	0,01
Lam Research Corp. 1.90% 20 - 15.06.30	75 000	USD	69 253	64 631	0,01
Lam Research Corp. 4.875% 19 - 15.03.49	25 000	USD	28 997	25 005	0,00
Lear Corp. 5.25% 19 - 15.05.49	25 000	USD	25 950	23 186	0,00
Legg Mason Inc. 5.625% 14 - 15.01.44	30 000	USD	35 344	30 814	0,01
Leggett & Platt Inc. 4.40% 19 - 15.03.29	30 000	USD	30 826	29 105	0,00
Lincoln National Corp. 3.40% 20 - 15.01.31	50 000	USD	49 330	44 837	0,01
Linde Inc. 1.10% 20 - 10.08.30	25 000	USD	22 117	20 763	0,00
Lowe's Cos Inc. 1.70% 20 - 15.10.30	25 000	USD	22 354	20 811	0,00
Lowe's Cos Inc. 1.70% 21 - 15.09.28	50 000	USD	46 507	44 189	0,01
Lowe's Cos Inc. 2.50% 16 - 15.04.26	25 000	USD	24 639	23 815	0,00
Lowe's Cos Inc. 2.80% 21 - 15.09.41	25 000	USD	21 458	18 261	0,00
Lowe's Cos Inc. 3.00% 20 - 15.10.50	25 000	USD	21 013	17 035	0,00
Lowe's Cos Inc. 3.10% 17 - 03.05.27	25 000	USD	24 842	23 981	0,00
Lowe's Cos Inc. 3.65% 19 - 05.04.29	25 000	USD	23 066	24 114	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Lowe's Cos Inc. 3.70% 16 - 15.04.46	75 000	USD	70 781	59 388	0,01
Lowe's Cos Inc. 4.00% 20 - 15.04.25	20 000	USD	20 227	19 740	0,00
Lowe's Cos Inc. 4.25% 22 - 01.04.52	75 000	USD	77 790	63 572	0,01
Lowe's Cos Inc. 4.50% 20 - 15.04.30	110 000	USD	109 794	109 570	0,02
Lowe's Cos Inc. 5.625% 22 - 15.04.53	95 000	USD	95 705	99 789	0,02
LYB International Finance III LLC 2.25% 20 - 01.10.30	40 000	USD	35 495	34 212	0,01
LYB International Finance III LLC 4.20% 19 - 15.10.49	40 000	USD	31 246	32 028	0,01
LYB International Finance III LLC 4.20% 20 - 01.05.50	25 000	USD	24 221	20 030	0,00
Manufacturers & Traders Trust Co. 4.65% 23 - 27.01.26	50 000	USD	48 232	48 948	0,01
Manufacturers & Traders Trust Co. 4.70% 23 - 27.01.28	50 000	USD	47 197	48 655	0,01
Marathon Petroleum Corp. 4.75% 14 - 15.09.44	50 000	USD	50 430	44 895	0,01
Marriott International Inc. 3.50% 20 - 15.10.32	70 000	USD	59 986	62 461	0,01
Marriott International Inc. 4.90% 23 - 15.04.29	50 000	USD	48 756	50 365	0,01
Marriott International Inc. 5.75% 20 - 01.05.25	40 000	USD	40 076	40 256	0,01
Marsh & McLennan Cos Inc. 2.25% 20 - 15.11.30	120 000	USD	104 704	103 813	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 3.50% 14 - 10.03.25	110 000	USD	108 828	108 058	0,02
Marsh & McLennan Cos Inc. 4.75% 19 - 15.03.39	25 000	USD	27 094	24 361	0,00
Marsh & McLennan Cos Inc. 4.90% 19 - 15.03.49	40 000	USD	44 846	38 800	0,01
Martin Marietta Materials Inc. 2.40% 21 - 15.07.31	75 000	USD	68 631	63 936	0,01
Marvell Technology Inc. 2.95% 21 - 15.04.31	50 000	USD	46 605	43 770	0,01
Masco Corp. 2.00% 21 - 15.02.31	20 000	USD	17 785	16 485	0,00
Mastercard Inc. 2.00% 19 - 03.03.25	25 000	USD	24 875	24 233	0,00
Mastercard Inc. 2.00% 21 - 18.11.31	25 000	USD	23 089	21 153	0,00
Mastercard Inc. 2.95% 19 - 01.06.29	50 000	USD	49 806	47 022	0,01
Mastercard Inc. 3.50% 18 - 26.02.28	140 000	USD	136 916	136 861	0,02
Mastercard Inc. 3.80% 16 - 21.11.46	25 000	USD	25 831	21 930	0,00
Mastercard Inc. 3.85% 20 - 26.03.50	50 000	USD	52 051	43 938	0,01
McCormick & Co. Inc. 3.40% 17 - 15.08.27	55 000	USD	55 343	52 555	0,01
McDonald's Corp. 2.375% 22 - 31.05.29	100 000	EUR	100 405	107 099	0,02
McDonald's Corp. 2.625% 19 - 01.09.29	25 000	USD	24 058	22 900	0,00
McDonald's Corp. 3.125% 17 - 04.03.25	10 000	CAD	7 991	7 439	0,00
McDonald's Corp. 3.30% 20 - 01.07.25	50 000	USD	50 287	48 889	0,01
McDonald's Corp. 3.50% 17 - 01.03.27	25 000	USD	25 308	24 357	0,00
McDonald's Corp. 3.50% 20 - 01.07.27	50 000	USD	50 516	48 656	0,01
McDonald's Corp. 4.20% 20 - 01.04.50	75 000	USD	76 685	66 437	0,01
McDonald's Corp. 4.60% 22 - 09.09.32	180 000	USD	179 182	182 767	0,03
McDonald's Corp. 4.70% 15 - 09.12.35	25 000	USD	26 684	24 752	0,00
McDonald's Corp. 6.30% 07 - 15.10.37	40 000	USD	49 195	45 442	0,01
MDC Holdings Inc. 6.00% 13 - 15.01.43	25 000	USD	25 716	23 379	0,00
Mead Johnson Nutrition Co. 4.60% 14 - 01.06.44	75 000	USD	79 134	70 204	0,01
Medtronic Inc. 4.375% 15 - 15.03.35	50 000	USD	47 639	48 904	0,01
Medtronic Inc. 4.625% 15 - 15.03.45	35 000	USD	35 353	34 208	0,01
Merck & Co. Inc. 0.75% 20 - 24.02.26	25 000	USD	24 069	23 184	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Merck & Co. Inc. 1.45% 20 - 24.06.30	25 000	USD	22 702	20 936	0,00
Merck & Co. Inc. 1.70% 21 - 10.06.27	25 000	USD	24 129	22 957	0,00
Merck & Co. Inc. 2.15% 21 - 10.12.31	25 000	USD	23 386	21 371	0,00
Merck & Co. Inc. 2.75% 15 - 10.02.25	75 000	USD	75 122	73 340	0,01
Merck & Co. Inc. 2.75% 21 - 10.12.51	100 000	USD	85 912	69 023	0,01
Merck & Co. Inc. 2.90% 21 - 10.12.61	40 000	USD	32 525	26 834	0,00
Merck & Co. Inc. 3.40% 19 - 07.03.29	80 000	USD	75 150	76 852	0,01
Merck & Co. Inc. 3.70% 15 - 10.02.45	75 000	USD	75 116	63 936	0,01
Merck & Co. Inc. 3.90% 19 - 07.03.39	50 000	USD	52 313	45 552	0,01
Merck & Co. Inc. 4.00% 19 - 07.03.49	100 000	USD	81 947	88 651	0,01
Merck & Co. Inc. 6.50% 03 - 01.12.33	25 000	USD	31 413	29 381	0,00
MetLife Inc. 4.05% 15 - 01.03.45	80 000	USD	80 484	69 789	0,01
MetLife Inc. 4.55% 20 - 23.03.30	50 000	USD	49 009	50 373	0,01
MetLife Inc. 5.00% 22 - 15.07.52	50 000	USD	48 912	49 793	0,01
MetLife Inc. 6.40% 06 - 15.12.36	30 000	USD	32 503	30 903	0,01
MetLife Inc. 6.50% 02 - 15.12.32	70 000	USD	84 795	79 673	0,01
Metropolitan Life Global Funding I 1.95% 21 - 20.03.28	20 000	CAD	14 988	13 804	0,00
Micron Technology Inc. 5.327% 19 - 06.02.29	100 000	USD	106 033	102 095	0,02
Micron Technology Inc. 6.75% 22 - 01.11.29	60 000	USD	63 125	64 914	0,01
Microsoft Corp. 2.40% 16 - 08.08.26	200 000	USD	194 491	190 906	0,03
Microsoft Corp. 2.525% 20 - 01.06.50	50 000	USD	34 785	34 252	0,01
Microsoft Corp. 2.675% 20 - 01.06.60	85 000	USD	72 447	57 125	0,01
Microsoft Corp. 2.70% 15 - 12.02.25	50 000	USD	50 180	48 927	0,01
Microsoft Corp. 2.921% 21 - 17.03.52	120 000	USD	110 139	88 549	0,01
Microsoft Corp. 3.041% 21 - 17.03.62	80 000	USD	59 972	58 026	0,01
Microsoft Corp. 3.125% 15 - 03.11.25	50 000	USD	50 523	48 854	0,01
Microsoft Corp. 4.10% 17 - 06.02.37	150 000	USD	164 011	147 492	0,02
Microsoft Corp. 5.20% 09 - 01.06.39	100 000	USD	109 631	110 490	0,02
Microsoft Corp. 5.30% 11 - 08.02.41	25 000	USD	30 685	28 261	0,00
Mondelez International Inc. 1.50% 20 - 04.05.25	25 000	USD	24 557	23 849	0,00
Mondelez International Inc. 1.875% 20 - 15.10.32	25 000	USD	22 008	20 409	0,00
Mondelez International Inc. 2.625% 20 - 04.09.50	25 000	USD	20 086	16 812	0,00
Mondelez International Inc. 3.25% 18 - 07.03.25	10 000	CAD	7 993	7 436	0,00
Moody's Corp. 5.25% 14 - 15.07.44	75 000	USD	85 267	76 439	0,01
Morgan Stanley FRN 20 - 10.12.26	160 000	USD	145 853	147 251	0,02
Morgan Stanley FRN 17 - 23.10.26	100 000	EUR	109 998	106 017	0,02
Morgan Stanley FRN 21 - 20.07.27	205 000	USD	194 074	187 395	0,03
Morgan Stanley FRN 21 - 04.05.27	120 000	USD	110 330	110 575	0,02
Morgan Stanley FRN 21 - 04.08.27	100 000	CAD	72 581	70 598	0,01
Morgan Stanley 1.875% 17 - 27.04.27	100 000	EUR	111 352	105 402	0,02
Morgan Stanley FRN 21 - 28.04.32	100 000	USD	88 484	80 376	0,01
Morgan Stanley FRN 21 - 21.07.32	100 000	USD	86 713	81 625	0,01
Morgan Stanley FRN 20 - 22.01.31	120 000	USD	113 318	105 218	0,02
Morgan Stanley FRN 21 - 25.01.52	125 000	USD	104 039	83 630	0,01
Morgan Stanley 3.125% 16 - 27.07.26	150 000	USD	144 195	143 674	0,02
Morgan Stanley FRN 17 - 22.07.28	55 000	USD	55 025	52 492	0,01
Morgan Stanley FRN 20 - 01.04.31	110 000	USD	109 413	101 379	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Morgan Stanley 3.625% 17 - 20.01.27	100 000	USD	98 667	97 057	0,01
Morgan Stanley FRN 18 - 24.01.29	55 000	USD	55 280	52 489	0,01
Morgan Stanley 4.30% 15 - 27.01.45	70 000	USD	72 462	63 427	0,01
Morgan Stanley 4.375% 17 - 22.01.47	85 000	USD	73 210	76 716	0,01
Morgan Stanley FRN 18 - 22.04.39	70 000	USD	74 318	64 752	0,01
Morgan Stanley 5.00% 13 - 24.11.25	150 000	USD	152 853	149 865	0,02
Morgan Stanley FRN 23 - 01.02.29	80 000	USD	80 371	80 410	0,01
Morgan Stanley FRN 22 - 25.01.34	100 000	EUR	102 013	121 326	0,02
Morgan Stanley FRN 23 - 19.01.38	140 000	USD	140 416	141 761	0,02
Morgan Stanley FRN 22 - 18.10.33	100 000	USD	101 647	107 893	0,02
Morgan Stanley 6.375% 12 - 24.07.42	50 000	USD	58 215	57 991	0,01
Morgan Stanley 7.25% 02 - 01.04.32	100 000	USD	114 027	118 055	0,02
Mosaic Co. 4.05% 17 - 15.11.27	25 000	USD	25 473	24 404	0,00
Mosaic Co. 5.625% 13 - 15.11.43	25 000	USD	29 383	24 751	0,00
Motorola Solutions Inc. 2.75% 21 - 24.05.31	50 000	USD	46 055	42 742	0,01
Motorola Solutions Inc. 4.60% 18 - 23.02.28	50 000	USD	51 123	49 781	0,01
MPLX LP 2.65% 20 - 15.08.30	25 000	USD	23 289	21 624	0,00
MPLX LP 4.00% 15 - 15.02.25	25 000	USD	24 544	24 631	0,00
MPLX LP 4.00% 18 - 15.03.28	100 000	USD	100 876	96 601	0,01
MPLX LP 4.50% 18 - 15.04.38	100 000	USD	100 860	89 212	0,01
MPLX LP 4.90% 18 - 15.04.58	40 000	USD	39 745	34 137	0,01
MPLX LP 4.95% 22 - 01.09.32	50 000	USD	47 405	49 054	0,01
Nasdaq Inc. 1.65% 20 - 15.01.31	30 000	USD	26 257	24 388	0,00
Nasdaq Inc. 3.25% 20 - 28.04.50	30 000	USD	25 671	21 257	0,00
Nasdaq Inc. 5.35% 23 - 28.06.28	100 000	USD	100 322	103 000	0,02
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 1.00% 21 - 15.06.26	125 000	USD	118 698	114 454	0,02
NetApp Inc. 1.875% 20 - 22.06.25	50 000	USD	49 032	47 568	0,01
Newmont Corp. 2.25% 20 - 01.10.30	25 000	USD	23 201	21 633	0,00
Newmont Corp. 2.60% 21 - 15.07.32	55 000	USD	51 096	47 109	0,01
Newmont Corp. 2.80% 19 - 01.10.29	100 000	USD	87 826	91 479	0,01
Newmont Corp. 6.25% 09 - 01.10.39	50 000	USD	61 311	55 559	0,01
Northern Trust Corp. 1.95% 20 - 01.05.30	50 000	USD	46 545	43 131	0,01
NOV Inc. 3.95% 12 - 01.12.42	25 000	USD	22 148	19 329	0,00
Novartis Capital Corp. 2.20% 20 - 14.08.30	100 000	USD	94 944	88 180	0,01
Novartis Capital Corp. 3.00% 15 - 20.11.25	70 000	USD	67 763	68 118	0,01
Novartis Capital Corp. 4.40% 14 - 06.05.44	40 000	USD	44 432	38 448	0,01
NSTAR Electric Co. 3.20% 17 - 15.05.27	25 000	USD	24 995	24 149	0,00
NVIDIA Corp. 1.55% 21 - 15.06.28	25 000	USD	23 528	22 408	0,00
NVIDIA Corp. 2.00% 21 - 15.06.31	25 000	USD	23 151	21 464	0,00
NVIDIA Corp. 2.85% 20 - 01.04.30	25 000	USD	24 570	23 154	0,00
NVIDIA Corp. 3.20% 16 - 16.09.26	25 000	USD	25 294	24 338	0,00
NVIDIA Corp. 3.50% 20 - 01.04.40	25 000	USD	24 847	21 767	0,00
NVIDIA Corp. 3.50% 20 - 01.04.50	50 000	USD	49 480	41 772	0,01
NVR Inc. 3.00% 20 - 15.05.30	25 000	USD	23 730	22 301	0,00
Omega Healthcare Investors Inc. 3.25% 21 - 15.04.33	50 000	USD	38 000	40 417	0,01
Omnicom Group Inc. 4.20% 20 - 01.06.30	50 000	USD	47 515	48 506	0,01
ONE Gas Inc. 4.658% 14 - 01.02.44	25 000	USD	26 390	22 725	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
ONEOK Inc. 3.10% 20 - 15.03.30	13 000	USD	12 356	11 690	0,00
ONEOK Inc. 4.35% 19 - 15.03.29	75 000	USD	76 030	72 919	0,01
ONEOK Inc. 4.45% 19 - 01.09.49	50 000	USD	48 083	42 026	0,01
ONEOK Inc. 5.65% 23 - 01.11.28	70 000	USD	71 986	72 421	0,01
ONEOK Inc. 5.85% 20 - 15.01.26	50 000	USD	50 434	50 781	0,01
ONEOK Inc. 6.35% 20 - 15.01.31	75 000	USD	80 909	80 177	0,01
Oracle Corp. 1.65% 21 - 25.03.26	80 000	USD	74 149	74 628	0,01
Oracle Corp. 2.30% 21 - 25.03.28	25 000	USD	23 473	22 776	0,00
Oracle Corp. 2.50% 20 - 01.04.25	50 000	USD	49 489	48 431	0,01
Oracle Corp. 2.65% 16 - 15.07.26	50 000	USD	47 127	47 441	0,01
Oracle Corp. 2.80% 20 - 01.04.27	100 000	USD	97 137	94 390	0,01
Oracle Corp. 2.875% 21 - 25.03.31	100 000	USD	91 919	88 655	0,01
Oracle Corp. 3.60% 20 - 01.04.50	100 000	USD	69 402	74 132	0,01
Oracle Corp. 3.65% 21 - 25.03.41	100 000	USD	86 781	79 609	0,01
Oracle Corp. 3.80% 17 - 15.11.37	100 000	USD	90 106	85 266	0,01
Oracle Corp. 3.90% 15 - 15.05.35	100 000	USD	93 090	89 156	0,01
Oracle Corp. 3.95% 21 - 25.03.51	220 000	USD	177 132	173 314	0,03
Oracle Corp. 4.00% 16 - 15.07.46	90 000	USD	68 894	72 392	0,01
Oracle Corp. 4.00% 17 - 15.11.47	80 000	USD	63 990	63 434	0,01
Oracle Corp. 4.10% 21 - 25.03.61	125 000	USD	105 481	95 642	0,01
Oracle Corp. 4.125% 15 - 15.05.45	100 000	USD	88 715	82 098	0,01
Oracle Corp. 6.25% 22 - 09.11.32	100 000	USD	105 479	108 841	0,02
Otis Worldwide Corp. 2.565% 20 - 15.02.30	50 000	USD	47 322	44 603	0,01
Otis Worldwide Corp. 3.362% 20 - 15.02.50	16 000	USD	14 051	12 423	0,00
Owens Corning 4.30% 17 - 15.07.47	25 000	USD	24 405	22 037	0,00
Paramount Global 2.90% 16 - 15.01.27	14 000	USD	13 763	12 976	0,00
Paramount Global 4.20% 20 - 19.05.32	50 000	USD	49 741	44 748	0,01
Paramount Global 4.375% 13 - 15.03.43	100 000	USD	94 329	74 440	0,01
Paramount Global 4.95% 20 - 15.01.31	50 000	USD	52 162	47 507	0,01
Paramount Global 4.95% 20 - 19.05.50	25 000	USD	25 687	20 333	0,00
Parker-Hannifin Corp. 3.25% 17 - 01.03.27	100 000	USD	100 206	96 067	0,01
Parker-Hannifin Corp. 4.10% 17 - 01.03.47	25 000	USD	24 653	21 702	0,00
Parker-Hannifin Corp. 4.25% 22 - 15.09.27	110 000	USD	109 081	109 085	0,02
PayPal Holdings Inc. 2.30% 20 - 01.06.30	50 000	USD	47 033	43 798	0,01
PayPal Holdings Inc. 2.65% 19 - 01.10.26	75 000	USD	74 332	71 272	0,01
PayPal Holdings Inc. 2.85% 19 - 01.10.29	120 000	USD	109 452	109 986	0,02
PayPal Holdings Inc. 3.25% 20 - 01.06.50	25 000	USD	22 487	18 767	0,00
PepsiCo Inc. 1.125% 19 - 18.03.31	100 000	EUR	107 301	98 440	0,01
PepsiCo Inc. 1.40% 20 - 25.02.31	50 000	USD	44 942	41 390	0,01
PepsiCo Inc. 1.625% 20 - 01.05.30	25 000	USD	22 975	21 313	0,00
PepsiCo Inc. 2.25% 20 - 19.03.25	75 000	USD	74 828	72 887	0,01
PepsiCo Inc. 2.375% 16 - 06.10.26	25 000	USD	24 759	23 769	0,00
PepsiCo Inc. 2.625% 21 - 21.10.41	25 000	USD	22 475	18 886	0,00
PepsiCo Inc. 2.75% 20 - 19.03.30	50 000	USD	49 108	45 965	0,01
PepsiCo Inc. 2.85% 16 - 24.02.26	25 000	USD	24 401	24 179	0,00
PepsiCo Inc. 3.00% 17 - 15.10.27	25 000	USD	25 182	24 045	0,00
PepsiCo Inc. 3.50% 15 - 17.07.25	100 000	USD	99 427	98 423	0,01
PepsiCo Inc. 3.625% 20 - 19.03.50	19 000	USD	19 249	16 013	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
PepsiCo Inc. 4.00% 17 - 02.05.47	75 000	USD	79 925	67 123	0,01
PepsiCo Inc. 5.50% 10 - 15.01.40	55 000	USD	60 579	59 523	0,01
Pfizer Inc. 0.80% 20 - 28.05.25	150 000	USD	145 299	142 000	0,02
Pfizer Inc. 1.70% 20 - 28.05.30	100 000	USD	85 995	85 303	0,01
Pfizer Inc. 2.75% 16 - 03.06.26	50 000	USD	47 633	47 941	0,01
Pfizer Inc. 4.20% 18 - 15.09.48	40 000	USD	39 025	36 256	0,01
Pfizer Inc. 4.40% 14 - 15.05.44	50 000	USD	45 694	47 414	0,01
Pfizer Inc. 7.20% 09 - 15.03.39	120 000	USD	149 115	149 099	0,02
Phillips 66 2.15% 20 - 15.12.30	100 000	USD	90 591	84 475	0,01
Phillips 66 4.875% 14 - 15.11.44	100 000	USD	108 692	96 078	0,01
Phillips 66 Co. 4.90% 23 - 01.10.46	10 000	USD	9 510	9 382	0,00
PNC Bank NA 3.10% 17 - 25.10.27	45 000	USD	44 984	42 263	0,01
PNC Bank NA 3.25% 15 - 01.06.25	40 000	USD	40 218	38 956	0,01
PNC Bank NA 3.875% 15 - 10.04.25	65 000	USD	65 612	63 664	0,01
PNC Bank NA 4.05% 18 - 26.07.28	25 000	USD	25 514	24 103	0,00
PNC Financial Services Group Inc. 1.15% 21 - 13.08.26	30 000	USD	28 675	27 285	0,00
PNC Financial Services Group Inc. FRN 21 - 23.04.32	20 000	USD	18 559	16 738	0,00
PNC Financial Services Group Inc. 2.55% 20 - 22.01.30	80 000	USD	76 663	70 045	0,01
PNC Financial Services Group Inc. FRN 22 - 06.06.33	140 000	USD	131 387	131 750	0,02
PNC Financial Services Group Inc. FRN 23 - 26.01.27	50 000	USD	48 244	49 619	0,01
PPG Industries Inc. 3.75% 18 - 15.03.28	25 000	USD	25 468	24 125	0,00
Principal Financial Group Inc. 6.05% 06 - 15.10.36	30 000	USD	36 162	32 304	0,01
Procter & Gamble Co. 0.55% 20 - 29.10.25	133 000	USD	125 116	124 318	0,02
Procter & Gamble Co. 1.00% 21 - 23.04.26	30 000	USD	28 135	27 856	0,00
Procter & Gamble Co. 1.20% 18 - 30.10.28	100 000	EUR	111 249	103 142	0,02
Procter & Gamble Co. 1.20% 20 - 29.10.30	50 000	USD	44 758	41 442	0,01
Procter & Gamble Co. 2.45% 16 - 03.11.26	50 000	USD	49 647	47 772	0,01
Procter & Gamble Co. 2.85% 17 - 11.08.27	25 000	USD	25 035	23 961	0,00
Procter & Gamble Co. 3.25% 23 - 02.08.31	100 000	EUR	110 781	113 949	0,02
Procter & Gamble Co. 5.55% 07 - 05.03.37	25 000	USD	31 004	28 062	0,00
Progressive Corp. 2.45% 16 - 15.01.27	75 000	USD	73 985	70 448	0,01
Progressive Corp. 4.20% 18 - 15.03.48	50 000	USD	52 115	44 747	0,01
Prologis Euro Finance LLC 0.50% 21 - 16.02.32	100 000	EUR	97 536	86 458	0,01
Prologis LP 1.25% 20 - 15.10.30	40 000	USD	35 085	32 408	0,01
Prologis LP 2.25% 20 - 15.04.30	30 000	USD	26 173	26 295	0,00
Prologis LP 5.25% 22 - 15.01.31	50 000	CAD	37 708	39 127	0,01
Prologis LP 5.25% 23 - 15.06.53	50 000	USD	49 360	52 242	0,01
Prudential Financial Inc. 3.00% 20 - 10.03.40	50 000	USD	38 941	38 984	0,01
Prudential Financial Inc. 3.70% 19 - 13.03.51	60 000	USD	45 575	47 741	0,01
Prudential Financial Inc. FRN 20 - 01.10.50	25 000	USD	23 041	21 656	0,00
Prudential Financial Inc. FRN 17 - 15.09.47	25 000	USD	24 094	23 356	0,00
Prudential Financial Inc. 4.60% 14 - 15.05.44	25 000	USD	26 619	23 347	0,00
Prudential Financial Inc. FRN 22 - 01.03.52	120 000	USD	108 030	112 740	0,02
Prudential Financial Inc. FRN 15 - 15.05.45	25 000	USD	25 064	24 702	0,00
Prudential Financial Inc. 5.70% 06 - 14.12.36	25 000	USD	29 319	27 099	0,00
Public Storage 0.875% 21 - 15.02.26	50 000	USD	46 139	46 282	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Public Storage Operating Co. 5.10% 23 - 01.08.33	40 000	USD	41 160	41 493	0,01
Public Storage Operating Co. 5.35% 23 - 01.08.53	50 000	USD	50 035	52 644	0,01
Qorvo Inc. 4.375% 20 - 15.10.29	25 000	USD	25 063	23 831	0,00
QUALCOMM Inc. 4.50% 22 - 20.05.52	100 000	USD	100 769	93 839	0,01
QUALCOMM Inc. 4.65% 15 - 20.05.35	150 000	USD	157 142	154 068	0,02
Quest Diagnostics Inc. 2.95% 19 - 30.06.30	60 000	USD	57 407	53 812	0,01
Ralph Lauren Corp. 2.95% 20 - 15.06.30	25 000	USD	24 192	22 817	0,00
Raymond James Financial Inc. 3.75% 21 - 01.04.51	45 000	USD	42 909	34 153	0,01
Regency Centers LP 3.60% 17 - 01.02.27	50 000	USD	50 555	48 101	0,01
Regeneron Pharmaceuticals Inc. 2.80% 20 - 15.09.50	25 000	USD	19 917	16 563	0,00
Regions Bank 6.45% 07 - 26.06.37	10 000	USD	12 114	10 185	0,00
Regions Financial Corp. 2.25% 20 - 18.05.25	15 000	USD	14 832	14 297	0,00
Reinsurance Group of America Inc. 3.15% 20 - 15.06.30	20 000	USD	19 292	17 984	0,00
RELX Capital Inc. 1.30% 15 - 12.05.25	100 000	EUR	102 977	107 332	0,02
RELX Capital Inc. 4.00% 19 - 18.03.29	50 000	USD	51 150	49 111	0,01
Republic Services Inc. 1.75% 20 - 15.02.32	100 000	USD	87 882	81 562	0,01
Rockwell Automation Inc. 4.20% 19 - 01.03.49	25 000	USD	26 196	22 562	0,00
Roper Technologies Inc. 2.95% 19 - 15.09.29	12 000	USD	11 649	11 004	0,00
S&P Global Inc. 1.25% 20 - 15.08.30	11 000	USD	9 752	9 026	0,00
S&P Global Inc. 2.30% 20 - 15.08.60	16 000	USD	11 736	9 652	0,00
S&P Global Inc. 2.45% 23 - 01.03.27	29 000	USD	28 505	27 366	0,00
S&P Global Inc. 2.50% 19 - 01.12.29	10 000	USD	9 572	9 027	0,00
S&P Global Inc. 2.90% 23 - 01.03.32	27 000	USD	26 196	24 138	0,00
S&P Global Inc. 3.25% 19 - 01.12.49	17 000	USD	15 786	12 813	0,00
S&P Global Inc. 3.70% 23 - 01.03.52	23 000	USD	22 904	19 176	0,00
S&P Global Inc. 3.90% 23 - 01.03.62	11 000	USD	11 035	9 256	0,00
S&P Global Inc. 4.25% 23 - 01.05.29	50 000	USD	51 786	49 906	0,01
Sabine Pass Liquefaction LLC 4.20% 17 - 15.03.28	25 000	USD	25 439	24 519	0,00
Sabine Pass Liquefaction LLC 4.50% 21 - 15.05.30	65 000	USD	67 307	63 670	0,01
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 16 - 01.03.25	50 000	USD	49 979	50 099	0,01
Salesforce Inc. 1.50% 21 - 15.07.28	25 000	USD	23 440	22 267	0,00
Salesforce Inc. 1.95% 21 - 15.07.31	25 000	USD	23 127	21 367	0,00
Salesforce Inc. 2.70% 21 - 15.07.41	25 000	USD	22 172	19 142	0,00
Salesforce Inc. 2.90% 21 - 15.07.51	50 000	USD	43 919	35 902	0,01
Salesforce Inc. 3.05% 21 - 15.07.61	25 000	USD	21 667	17 620	0,00
Salesforce Inc. 3.70% 18 - 11.04.28	25 000	USD	25 608	24 516	0,00
Santander Holdings USA Inc. 3.45% 20 - 02.06.25	155 000	USD	154 658	150 587	0,02
ServiceNow Inc. 1.40% 20 - 01.09.30	25 000	USD	21 954	20 583	0,00
Sherwin-Williams Co. 2.30% 20 - 15.05.30	25 000	USD	23 309	21 821	0,00
Sherwin-Williams Co. 2.95% 19 - 15.08.29	25 000	USD	24 282	23 089	0,00
Sherwin-Williams Co. 3.45% 17 - 01.06.27	25 000	USD	25 038	24 163	0,00
Sherwin-Williams Co. 3.80% 19 - 15.08.49	40 000	USD	38 202	32 156	0,01
Sherwin-Williams Co. 4.50% 17 - 01.06.47	25 000	USD	25 920	22 924	0,00
Simon Property Group LP 3.25% 16 - 30.11.26	50 000	USD	47 807	48 061	0,01
Simon Property Group LP 3.50% 15 - 01.09.25	50 000	USD	48 381	48 895	0,01
Simon Property Group LP 3.80% 20 - 15.07.50	140 000	USD	105 951	111 241	0,02
Sonoco Products Co. 5.75% 10 - 01.11.40	50 000	USD	58 252	51 302	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Stanley Black & Decker Inc. FRN 20 - 15.03.60	100 000	USD	97 861	83 638	0,01
Starbucks Corp. 2.25% 20 - 12.03.30	50 000	USD	46 494	43 944	0,01
Starbucks Corp. 3.55% 19 - 15.08.29	25 000	USD	25 058	24 127	0,00
Starbucks Corp. 3.80% 18 - 15.08.25	25 000	USD	25 316	24 554	0,00
Starbucks Corp. 4.00% 18 - 15.11.28	25 000	USD	25 652	24 647	0,00
Starbucks Corp. 4.45% 19 - 15.08.49	75 000	USD	77 271	68 487	0,01
State Street Corp. FRN 19 - 01.11.34	40 000	USD	38 507	35 908	0,01
State Street Corp. 3.55% 15 - 18.08.25	100 000	USD	98 785	98 172	0,01
State Street Corp. FRN 23 - 26.01.34	80 000	USD	74 916	78 878	0,01
Stryker Corp. 2.125% 18 - 30.11.27	100 000	EUR	102 478	106 907	0,02
Stryker Corp. 3.65% 18 - 07.03.28	100 000	USD	97 272	96 877	0,01
Synchrony Bank 5.40% 22 - 22.08.25	120 000	USD	116 275	118 160	0,02
Synchrony Financial 2.875% 21 - 28.10.31	50 000	USD	45 223	40 135	0,01
Sysco Corp. 3.15% 21 - 14.12.51	25 000	USD	20 941	17 957	0,00
Sysco Corp. 3.25% 17 - 15.07.27	25 000	USD	24 935	23 930	0,00
Sysco Corp. 3.30% 16 - 15.07.26	25 000	USD	25 064	24 153	0,00
Sysco Corp. 3.75% 15 - 01.10.25	25 000	USD	25 243	24 445	0,00
Sysco Corp. 4.50% 16 - 01.04.46	25 000	USD	25 262	22 305	0,00
Sysco Corp. 5.95% 20 - 01.04.30	25 000	USD	28 010	26 640	0,00
Targa Resources Corp. 4.20% 22 - 01.02.33	50 000	USD	41 663	46 082	0,01
Targa Resources Corp. 4.95% 22 - 15.04.52	50 000	USD	36 676	44 058	0,01
Targa Resources Corp. 6.50% 23 - 15.02.53	50 000	USD	50 837	54 246	0,01
Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp. 5.00% 17 - 15.01.28	50 000	USD	48 523	49 437	0,01
Target Corp. 2.25% 20 - 15.04.25	25 000	USD	24 876	24 242	0,00
Target Corp. 2.35% 20 - 15.02.30	50 000	USD	48 069	44 770	0,01
Target Corp. 2.50% 16 - 15.04.26	25 000	USD	25 017	24 079	0,00
Target Corp. 3.625% 16 - 15.04.46	50 000	USD	50 619	41 514	0,01
Target Corp. 4.00% 12 - 01.07.42	65 000	USD	60 101	59 085	0,01
Target Corp. 4.80% 23 - 15.01.53	60 000	USD	60 267	59 692	0,01
Texas Instruments Inc. 1.375% 20 - 12.03.25	25 000	USD	24 646	24 054	0,00
Texas Instruments Inc. 1.75% 20 - 04.05.30	25 000	USD	23 202	21 641	0,00
Texas Instruments Inc. 2.25% 19 - 04.09.29	25 000	USD	24 079	22 575	0,00
Texas Instruments Inc. 3.875% 19 - 15.03.39	25 000	USD	26 060	23 175	0,00
Texas Instruments Inc. 4.15% 18 - 15.05.48	25 000	USD	27 188	22 779	0,00
Texas Instruments Inc. 4.90% 23 - 14.03.33	100 000	USD	100 982	103 971	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.75% 21 - 15.10.28	15 000	USD	14 035	13 391	0,00
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.00% 14 - 15.04.25	100 000	EUR	111 606	108 207	0,02
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.00% 21 - 15.10.31	25 000	USD	22 790	21 105	0,00
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.60% 19 - 01.10.29	25 000	USD	24 131	22 800	0,00
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.80% 21 - 15.10.41	25 000	USD	22 361	19 019	0,00
Thermo Fisher Scientific Inc. 4.10% 17 - 15.08.47	25 000	USD	26 391	22 371	0,00
Time Warner Cable LLC 4.50% 12 - 15.09.42	50 000	USD	33 036	39 536	0,01
Time Warner Cable LLC 5.875% 10 - 15.11.40	50 000	USD	39 567	45 510	0,01
TJX Cos Inc. 2.25% 16 - 15.09.26	25 000	USD	24 549	23 634	0,00
Trane Technologies Global Holdings Co. Ltd. 5.75% 14 - 15.06.43	11 000	USD	13 083	11 846	0,00
Travelers Cos Inc. 3.05% 21 - 08.06.51	160 000	USD	116 745	118 248	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Travelers Cos Inc. 3.75% 16 - 15.05.46	40 000	USD	39 021	33 091	0,01
Travelers Cos Inc. 4.10% 19 - 04.03.49	55 000	USD	56 154	48 113	0,01
Travelers Cos Inc. 5.35% 10 - 01.11.40	20 000	USD	23 421	20 945	0,00
Travelers Property Casualty Corp. 6.375% 03 - 15.03.33	10 000	USD	12 110	11 459	0,00
Truist Bank 3.30% 16 - 15.05.26	30 000	USD	30 116	28 619	0,00
Truist Financial Corp. 1.125% 20 - 03.08.27	40 000	USD	37 230	35 114	0,01
Truist Financial Corp. 1.20% 20 - 05.08.25	100 000	USD	97 295	93 916	0,01
Truist Financial Corp. FRN 23 - 26.01.29	100 000	USD	95 697	98 858	0,01
Truist Financial Corp. FRN 23 - 08.06.27	50 000	USD	50 133	50 895	0,01
Truist Financial Corp. FRN 22 - 28.10.33	50 000	USD	54 155	51 960	0,01
Truist Financial Corp. FRN 23 - 30.10.29	50 000	USD	52 238	54 048	0,01
TSMC Arizona Corp. 1.75% 21 - 25.10.26	50 000	USD	48 100	46 099	0,01
TSMC Arizona Corp. 2.50% 21 - 25.10.31	100 000	USD	93 103	85 793	0,01
TSMC Arizona Corp. 3.125% 21 - 25.10.41	50 000	USD	45 740	40 560	0,01
TWDC Enterprises 18 Corp. 2.95% 17 - 15.06.27	25 000	USD	24 917	24 001	0,00
TWDC Enterprises 18 Corp. 7.00% 02 - 01.03.32	70 000	USD	80 015	82 020	0,01
Tyson Foods Inc. 3.55% 17 - 02.06.27	25 000	USD	25 114	23 877	0,00
Tyson Foods Inc. 4.35% 19 - 01.03.29	25 000	USD	25 892	24 327	0,00
Tyson Foods Inc. 4.55% 17 - 02.06.47	25 000	USD	26 249	21 048	0,00
Tyson Foods Inc. 4.875% 14 - 15.08.34	25 000	USD	26 690	24 287	0,00
Tyson Foods Inc. 5.10% 18 - 28.09.48	25 000	USD	28 190	22 779	0,00
Unilever Capital Corp. 1.375% 20 - 14.09.30	100 000	USD	88 815	82 715	0,01
Unilever Capital Corp. 1.75% 21 - 12.08.31	80 000	USD	65 912	66 611	0,01
Union Pacific Corp. 2.375% 21 - 20.05.31	25 000	USD	23 685	21 767	0,00
Union Pacific Corp. 2.40% 20 - 05.02.30	25 000	USD	23 914	22 351	0,00
Union Pacific Corp. 2.95% 21 - 10.03.52	150 000	USD	131 086	106 620	0,02
Union Pacific Corp. 3.25% 15 - 15.08.25	150 000	USD	150 795	146 650	0,02
Union Pacific Corp. 3.70% 19 - 01.03.29	50 000	USD	51 111	48 906	0,01
Union Pacific Corp. 3.839% 20 - 20.03.60	117 000	USD	93 921	95 708	0,01
Union Pacific Corp. 4.30% 19 - 01.03.49	40 000	USD	42 694	35 631	0,01
United Parcel Service Inc. 1.625% 15 - 15.11.25	100 000	EUR	105 673	107 530	0,02
United Parcel Service Inc. 3.05% 17 - 15.11.27	25 000	USD	25 165	23 955	0,00
United Parcel Service Inc. 3.40% 19 - 15.03.29	25 000	USD	25 415	24 217	0,00
United Parcel Service Inc. 3.40% 19 - 01.09.49	50 000	USD	41 961	40 332	0,01
United Parcel Service Inc. 3.75% 17 - 15.11.47	90 000	USD	77 202	76 474	0,01
United Parcel Service Inc. 4.45% 20 - 01.04.30	25 000	USD	26 762	25 284	0,00
United Parcel Service Inc. 4.875% 10 - 15.11.40	60 000	USD	68 309	60 340	0,01
United States Zero Coupon 20 - 15.05.40	450 000	USD	355 627	291 094	0,04
United States Zero Coupon 20 - 30.06.27	410 000	USD	384 467	364 355	0,05
United States Zero Coupon 20 - 31.10.25	500 000	USD	481 043	464 473	0,07
United States Zero Coupon 20 - 31.10.27	405 000	USD	366 080	356 368	0,05
United States Zero Coupon 21 - 31.01.26	660 000	USD	633 134	609 727	0,09
United States Zero Coupon 21 - 31.03.26	850 000	USD	819 502	788 906	0,12
United States Zero Coupon 21 - 30.04.26	625 000	USD	601 777	578 369	0,09
United States Zero Coupon 21 - 30.04.28	750 000	USD	714 425	672 012	0,10
United States Zero Coupon 21 - 31.05.28	875 000	USD	819 142	782 373	0,11
United States Zero Coupon 21 - 15.05.41	610 000	USD	576 169	466 269	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 21 - 30.06.26	575 000	USD	553 855	531 830	0,08
United States Zero Coupon 21 - 31.07.26	630 000	USD	602 215	577 188	0,08
United States Zero Coupon 21 - 31.07.28	675 000	USD	634 031	594 105	0,09
United States Zero Coupon 21 - 31.08.28	670 000	USD	632 205	592 060	0,09
United States Zero Coupon 21 - 15.08.41	720 000	USD	613 692	502 537	0,07
United States Zero Coupon 21 - 30.09.26	400 000	USD	383 901	367 531	0,05
United States Zero Coupon 21 - 30.09.28	680 000	USD	644 789	603 128	0,09
United States Zero Coupon 21 - 30.11.26	400 000	USD	387 269	369 969	0,05
United States Zero Coupon 21 - 31.12.26	630 000	USD	609 268	581 716	0,09
United States Zero Coupon 21 - 31.12.28	620 000	USD	590 227	550 637	0,08
United States Zero Coupon 22 - 31.01.29	893 000	USD	812 436	806 560	0,12
United States Zero Coupon 22 - 28.02.27	500 000	USD	492 342	468 945	0,07
United States Zero Coupon 22 - 28.02.29	530 000	USD	516 370	481 141	0,07
United States Zero Coupon 22 - 15.02.42	555 900	USD	482 026	428 130	0,06
United States Zero Coupon 22 - 31.03.27	394 000	USD	390 093	376 732	0,06
United States Zero Coupon 22 - 31.03.29	498 000	USD	485 797	462 868	0,07
United States Zero Coupon 22 - 30.04.27	500 000	USD	500 450	481 211	0,07
United States Zero Coupon 22 - 30.04.29	600 000	USD	584 693	571 500	0,08
United States Zero Coupon 22 - 15.05.42	478 000	USD	443 728	421 013	0,06
United States Zero Coupon 22 - 31.07.27	500 000	USD	492 829	480 273	0,07
United States Zero Coupon 22 - 30.11.29	364 000	USD	363 064	363 886	0,05
United States Zero Coupon 23 - 29.02.28	460 000	USD	456 963	461 869	0,07
United States Zero Coupon 23 - 15.02.43	480 000	USD	480 894	459 375	0,07
United States Zero Coupon 23 - 31.03.25	480 000	USD	474 909	475 819	0,07
United States Zero Coupon 23 - 30.04.28	540 000	USD	540 111	531 900	0,08
United States Zero Coupon 23 - 30.06.30	100 000	USD	98 147	99 266	0,02
United States Zero Coupon 23 - 30.09.25	700 000	USD	704 785	707 219	0,10
United States Zero Coupon 23 - 30.09.28	570 000	USD	564 860	588 926	0,09
United States 0.25% 20 - 31.05.25	455 000	USD	441 790	428 446	0,06
United States 0.25% 20 - 30.06.25	500 000	USD	484 569	469 648	0,07
United States 0.25% 20 - 31.07.25	500 000	USD	483 683	468 242	0,07
United States 0.25% 20 - 31.08.25	480 000	USD	459 589	448 181	0,07
United States 0.25% 20 - 30.09.25	550 000	USD	525 445	512 230	0,08
United States 0.375% 20 - 30.04.25	465 000	USD	453 101	440 061	0,06
United States 0.375% 20 - 31.07.27	480 000	USD	447 444	423 637	0,06
United States 0.375% 20 - 30.09.27	850 000	USD	765 399	746 074	0,11
United States 0.375% 20 - 30.11.25	500 000	USD	481 296	464 395	0,07
United States 0.375% 20 - 31.12.25	610 000	USD	586 289	565 418	0,08
United States 0.50% 20 - 31.03.25	500 000	USD	488 809	475 410	0,07
United States 0.50% 20 - 30.04.27	350 000	USD	323 731	312 594	0,05
United States 0.50% 20 - 31.05.27	355 000	USD	333 270	316 255	0,05
United States 0.50% 20 - 31.08.27	400 000	USD	364 783	353 656	0,05
United States 0.50% 21 - 28.02.26	700 000	USD	668 691	646 898	0,10
United States 0.625% 20 - 31.03.27	250 000	USD	236 486	224 785	0,03
United States 0.625% 20 - 15.05.30	922 000	USD	774 978	754 743	0,11
United States 0.625% 20 - 15.08.30	1 340 000	USD	1 110 426	1 088 959	0,16
United States 0.625% 20 - 30.11.27	550 000	USD	502 457	485 074	0,07
United States 0.625% 20 - 31.12.27	800 000	USD	731 133	703 812	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.75% 21 - 31.01.28	900 000	USD	800 989	794 039	0,12
United States 0.75% 21 - 31.05.26	650 000	USD	624 977	600 234	0,09
United States 0.75% 21 - 31.08.26	670 000	USD	641 780	614 516	0,09
United States 0.875% 20 - 15.11.30	950 000	USD	853 745	781 820	0,11
United States 1.125% 20 - 28.02.25	470 000	USD	460 077	451 365	0,07
United States 1.125% 20 - 28.02.27	160 000	USD	146 855	146 612	0,02
United States 1.125% 20 - 15.08.40	520 000	USD	415 857	333 125	0,05
United States 1.125% 21 - 15.02.31	922 700	USD	834 456	771 608	0,11
United States 1.125% 21 - 29.02.28	685 000	USD	650 758	612 861	0,09
United States 1.125% 21 - 31.10.26	660 000	USD	637 013	609 211	0,09
United States 1.125% 22 - 15.01.25	350 000	USD	345 195	337 176	0,05
United States 1.25% 20 - 15.05.50	689 600	USD	398 524	373 677	0,06
United States 1.25% 21 - 31.03.28	1 050 000	USD	961 010	942 457	0,14
United States 1.25% 21 - 30.06.28	635 000	USD	603 591	566 737	0,08
United States 1.25% 21 - 15.08.31	1 450 000	USD	1 272 603	1 202 594	0,18
United States 1.375% 19 - 31.08.26	380 000	USD	370 015	354 350	0,05
United States 1.375% 20 - 31.01.25	400 000	USD	395 881	386 000	0,06
United States 1.375% 20 - 15.08.50	755 400	USD	447 848	423 024	0,06
United States 1.375% 20 - 15.11.40	555 000	USD	460 844	369 595	0,05
United States 1.375% 21 - 31.10.28	660 000	USD	628 873	588 070	0,09
United States 1.375% 21 - 15.11.31	1 200 000	USD	1 059 404	998 250	0,15
United States 1.50% 16 - 15.08.26	600 000	USD	586 286	561 656	0,08
United States 1.50% 20 - 31.01.27	882 000	USD	836 908	819 157	0,12
United States 1.50% 20 - 15.02.30	300 000	USD	275 987	261 750	0,04
United States 1.50% 21 - 30.11.28	970 000	USD	880 560	868 150	0,13
United States 1.50% 22 - 15.02.25	750 000	USD	737 444	723 838	0,11
United States 1.625% 16 - 15.02.26	520 000	USD	511 509	492 862	0,07
United States 1.625% 16 - 15.05.26	790 000	USD	775 620	745 562	0,11
United States 1.625% 19 - 15.08.29	505 000	USD	485 120	450 042	0,07
United States 1.625% 19 - 30.09.26	450 000	USD	426 574	422 051	0,06
United States 1.625% 19 - 31.10.26	248 000	USD	232 432	232 248	0,03
United States 1.625% 19 - 30.11.26	240 000	USD	234 855	224 400	0,03
United States 1.625% 20 - 15.11.50	740 000	USD	606 866	442 959	0,07
United States 1.625% 21 - 15.05.31	1 150 000	USD	1 076 799	988 102	0,14
United States 1.75% 19 - 15.11.29	375 000	USD	362 609	335 186	0,05
United States 1.75% 19 - 31.12.26	245 000	USD	229 902	229 630	0,03
United States 1.75% 22 - 15.03.25	310 000	USD	307 350	299 586	0,04
United States 1.875% 19 - 30.06.26	350 000	USD	336 646	331 980	0,05
United States 1.875% 19 - 31.07.26	300 000	USD	287 741	283 898	0,04
United States 1.875% 21 - 15.02.51	880 000	USD	749 968	561 000	0,08
United States 1.875% 21 - 15.02.41	675 000	USD	604 647	487 160	0,07
United States 1.875% 21 - 15.11.51	891 000	USD	725 726	565 924	0,08
United States 1.875% 22 - 15.02.32	1 410 000	USD	1 317 771	1 214 583	0,18
United States 2.00% 15 - 15.02.25	590 000	USD	587 666	572 577	0,08
United States 2.00% 15 - 15.08.25	850 000	USD	826 647	817 992	0,12
United States 2.00% 16 - 15.11.26	580 000	USD	566 194	548 598	0,08
United States 2.00% 20 - 15.02.50	570 000	USD	510 077	376 823	0,06
United States 2.00% 21 - 15.08.51	840 000	USD	680 297	551 119	0,08

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.00% 21 - 15.11.41	650 000	USD	560 870	471 859	0,07
United States 2.125% 15 - 15.05.25	700 000	USD	697 539	677 660	0,10
United States 2.125% 19 - 31.05.26	430 000	USD	426 964	410 650	0,06
United States 2.25% 15 - 15.11.25	750 000	USD	738 916	722 402	0,11
United States 2.25% 16 - 15.08.46	340 000	USD	316 949	242 728	0,04
United States 2.25% 17 - 15.02.27	445 000	USD	442 868	422 576	0,06
United States 2.25% 17 - 15.08.27	480 000	USD	477 316	452 850	0,07
United States 2.25% 17 - 15.11.27	710 000	USD	705 486	667 955	0,10
United States 2.25% 19 - 31.03.26	272 000	USD	268 849	260 950	0,04
United States 2.25% 19 - 15.08.49	485 000	USD	457 102	340 182	0,05
United States 2.25% 22 - 15.02.52	760 000	USD	678 751	529 387	0,08
United States 2.375% 17 - 15.05.27	670 000	USD	649 743	636 709	0,09
United States 2.375% 19 - 30.04.26	196 800	USD	196 555	189 143	0,03
United States 2.375% 19 - 15.05.29	545 000	USD	544 184	505 956	0,07
United States 2.375% 19 - 15.11.49	435 000	USD	378 774	313 404	0,05
United States 2.375% 21 - 15.05.51	796 000	USD	760 616	570 757	0,08
United States 2.50% 15 - 15.02.45	380 000	USD	368 740	288 741	0,04
United States 2.50% 16 - 15.02.46	270 000	USD	255 254	203 302	0,03
United States 2.50% 16 - 15.05.46	300 000	USD	291 995	225 422	0,03
United States 2.50% 18 - 31.01.25	177 000	USD	173 486	172 852	0,03
United States 2.50% 19 - 28.02.26	460 000	USD	448 505	444 008	0,07
United States 2.625% 18 - 31.03.25	161 000	USD	161 485	157 201	0,02
United States 2.625% 18 - 31.12.25	220 000	USD	220 854	213 245	0,03
United States 2.625% 19 - 31.01.26	316 800	USD	303 987	306 900	0,05
United States 2.625% 19 - 15.02.29	665 000	USD	671 303	626 918	0,09
United States 2.625% 22 - 15.04.25	485 000	USD	484 908	473 046	0,07
United States 2.625% 22 - 31.05.27	700 000	USD	687 213	670 414	0,10
United States 2.625% 22 - 31.07.29	400 000	USD	378 100	375 125	0,06
United States 2.75% 12 - 15.08.42	170 000	USD	171 596	138 311	0,02
United States 2.75% 12 - 15.11.42	237 000	USD	215 434	192 229	0,03
United States 2.75% 17 - 15.08.47	400 000	USD	326 138	312 875	0,05
United States 2.75% 17 - 15.11.47	400 000	USD	351 307	312 750	0,05
United States 2.75% 18 - 15.02.28	710 000	USD	718 764	678 993	0,10
United States 2.75% 18 - 28.02.25	450 000	USD	451 878	440 297	0,06
United States 2.75% 18 - 30.06.25	500 000	USD	502 447	487 812	0,07
United States 2.75% 18 - 31.08.25	480 000	USD	482 559	467 306	0,07
United States 2.75% 22 - 15.05.25	477 000	USD	477 173	465 597	0,07
United States 2.75% 22 - 31.05.29	500 000	USD	492 255	472 773	0,07
United States 2.75% 22 - 15.08.32	1 383 000	USD	1 289 062	1 269 119	0,19
United States 2.875% 13 - 15.05.43	348 900	USD	297 116	287 461	0,04
United States 2.875% 15 - 15.08.45	240 000	USD	247 802	194 175	0,03
United States 2.875% 16 - 15.11.46	170 000	USD	176 678	136 637	0,02
United States 2.875% 18 - 30.04.25	500 000	USD	490 070	489 082	0,07
United States 2.875% 18 - 15.05.28	950 000	USD	961 831	911 777	0,13
United States 2.875% 18 - 31.05.25	640 000	USD	644 193	625 375	0,09
United States 2.875% 18 - 15.08.28	890 000	USD	897 795	852 453	0,13
United States 2.875% 19 - 15.05.49	450 000	USD	476 299	359 227	0,05
United States 2.875% 22 - 15.05.32	1 210 000	USD	1 203 658	1 123 409	0,16

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.875% 22 - 15.05.52	750 000	USD	712 734	599 883	0,09
United States 2.875% 22 - 15.06.25	400 000	USD	399 165	390 969	0,06
United States 3.00% 12 - 15.05.42	145 000	USD	152 008	123 114	0,02
United States 3.00% 14 - 15.11.44	275 000	USD	288 631	228 336	0,03
United States 3.00% 15 - 15.05.45	145 000	USD	142 704	120 010	0,02
United States 3.00% 15 - 15.11.45	140 000	USD	147 582	115 566	0,02
United States 3.00% 17 - 15.02.47	303 000	USD	321 807	248 649	0,04
United States 3.00% 17 - 15.05.47	250 000	USD	265 983	205 039	0,03
United States 3.00% 18 - 15.02.48	390 000	USD	345 650	319 130	0,05
United States 3.00% 18 - 15.08.48	455 000	USD	452 200	371 962	0,05
United States 3.00% 18 - 30.09.25	290 000	USD	292 802	283 362	0,04
United States 3.00% 18 - 31.10.25	500 000	USD	483 868	488 418	0,07
United States 3.00% 19 - 15.02.49	466 600	USD	479 731	381 373	0,06
United States 3.00% 22 - 15.07.25	600 000	USD	587 493	586 945	0,09
United States 3.00% 22 - 15.08.52	669 000	USD	592 990	549 625	0,08
United States 3.125% 11 - 15.11.41	150 000	USD	159 872	130 852	0,02
United States 3.125% 12 - 15.02.42	200 000	USD	196 061	173 906	0,03
United States 3.125% 13 - 15.02.43	326 000	USD	285 357	279 698	0,04
United States 3.125% 14 - 15.08.44	325 000	USD	317 602	275 996	0,04
United States 3.125% 18 - 15.05.48	480 700	USD	460 095	402 136	0,06
United States 3.125% 18 - 15.11.28	710 000	USD	731 936	686 703	0,10
United States 3.125% 22 - 15.08.25	200 000	USD	198 886	196 008	0,03
United States 3.125% 22 - 31.08.27	600 000	USD	584 197	583 500	0,09
United States 3.125% 22 - 31.08.29	400 000	USD	379 313	384 750	0,06
United States 3.25% 22 - 30.06.27	600 000	USD	601 812	586 594	0,09
United States 3.25% 22 - 30.06.29	637 000	USD	637 041	617 492	0,09
United States 3.375% 14 - 15.05.44	240 000	USD	265 480	212 287	0,03
United States 3.375% 18 - 15.11.48	450 000	USD	516 628	393 750	0,06
United States 3.375% 22 - 15.08.42	385 000	USD	358 340	344 575	0,05
United States 3.375% 23 - 15.05.33	2 414 500	USD	2 298 822	2 322 447	0,34
United States 3.50% 09 - 15.02.39	180 000	USD	184 343	170 944	0,03
United States 3.50% 22 - 15.09.25	450 000	USD	443 324	443 408	0,07
United States 3.50% 23 - 31.01.28	650 000	USD	648 657	640 199	0,09
United States 3.50% 23 - 31.01.30	227 000	USD	227 938	222 354	0,03
United States 3.50% 23 - 15.02.33	1 327 000	USD	1 324 226	1 289 471	0,19
United States 3.50% 23 - 30.04.30	400 000	USD	400 736	391 594	0,06
United States 3.625% 13 - 15.08.43	300 000	USD	313 054	276 797	0,04
United States 3.625% 14 - 15.02.44	265 000	USD	302 948	243 552	0,04
United States 3.625% 23 - 15.02.53	800 000	USD	787 031	742 125	0,11
United States 3.625% 23 - 31.03.28	400 000	USD	400 666	395 937	0,06
United States 3.625% 23 - 31.03.30	420 000	USD	421 922	414 127	0,06
United States 3.625% 23 - 15.05.26	492 700	USD	482 015	487 157	0,07
United States 3.625% 23 - 15.05.53	520 000	USD	492 707	483 031	0,07
United States 3.625% 23 - 31.05.28	740 000	USD	736 300	732 889	0,11
United States 3.75% 11 - 15.08.41	140 000	USD	161 596	133 678	0,02
United States 3.75% 13 - 15.11.43	245 000	USD	284 390	229 649	0,03
United States 3.75% 23 - 15.04.26	460 000	USD	459 987	455 831	0,07
United States 3.75% 23 - 31.05.30	422 400	USD	414 205	419 298	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.75% 24 - 31.12.28	669 000	USD	666 232	666 619	0,10
United States 3.875% 10 - 15.08.40	100 000	USD	117 044	97 812	0,01
United States 3.875% 22 - 30.09.29	400 000	USD	401 476	399 812	0,06
United States 3.875% 22 - 30.11.27	680 000	USD	686 035	678 937	0,10
United States 3.875% 23 - 31.12.27	750 000	USD	751 532	749 355	0,11
United States 3.875% 23 - 31.12.29	372 000	USD	373 126	371 884	0,05
United States 3.875% 23 - 15.01.26	430 000	USD	430 036	426 809	0,06
United States 3.875% 23 - 30.04.25	600 000	USD	599 235	594 609	0,09
United States 3.875% 23 - 15.05.43	455 300	USD	439 693	435 736	0,06
United States 3.875% 23 - 15.08.33	1 380 000	USD	1 318 693	1 381 078	0,20
United States 4.00% 22 - 31.10.29	500 000	USD	494 983	503 125	0,07
United States 4.00% 22 - 15.11.52	638 000	USD	668 611	632 218	0,09
United States 4.00% 22 - 15.11.42	500 000	USD	506 717	487 734	0,07
United States 4.00% 22 - 15.12.25	200 000	USD	200 555	198 969	0,03
United States 4.00% 23 - 15.02.26	650 000	USD	649 816	647 156	0,10
United States 4.00% 23 - 28.02.30	305 000	USD	314 761	306 930	0,05
United States 4.00% 23 - 30.06.28	518 300	USD	515 568	521 215	0,08
United States 4.00% 23 - 31.07.30	407 000	USD	398 562	409 925	0,06
United States 4.125% 22 - 30.09.27	453 300	USD	456 405	456 381	0,07
United States 4.125% 22 - 31.10.27	492 000	USD	496 233	495 382	0,07
United States 4.125% 22 - 15.11.32	1 195 000	USD	1 235 601	1 217 220	0,18
United States 4.125% 23 - 31.01.25	380 000	USD	379 611	377 640	0,06
United States 4.125% 23 - 15.06.26	650 000	USD	645 828	650 102	0,10
United States 4.125% 23 - 31.07.28	550 000	USD	548 938	556 187	0,08
United States 4.125% 23 - 15.08.53	726 000	USD	634 481	737 344	0,11
United States 4.125% 23 - 31.08.30	400 000	USD	404 491	405 687	0,06
United States 4.25% 09 - 15.05.39	120 000	USD	127 389	124 012	0,02
United States 4.25% 10 - 15.11.40	200 000	USD	212 010	204 469	0,03
United States 4.25% 22 - 15.10.25	400 000	USD	398 704	399 297	0,06
United States 4.25% 23 - 31.05.25	620 000	USD	618 784	617 699	0,09
United States 4.375% 08 - 15.02.38	75 000	USD	92 143	79 043	0,01
United States 4.375% 09 - 15.11.39	140 000	USD	173 253	146 278	0,02
United States 4.375% 10 - 15.05.40	150 000	USD	186 055	156 258	0,02
United States 4.375% 11 - 15.05.41	131 000	USD	146 565	135 462	0,02
United States 4.375% 23 - 15.08.26	550 000	USD	547 670	553 867	0,08
United States 4.375% 23 - 31.08.28	566 800	USD	569 949	579 464	0,09
United States 4.375% 23 - 15.08.43	437 200	USD	432 612	447 925	0,07
United States 4.375% 23 - 30.11.28	640 000	USD	642 611	655 600	0,10
United States 4.375% 23 - 30.11.30	400 000	USD	410 879	412 062	0,06
United States 4.375% 23 - 15.12.26	577 000	USD	582 659	582 860	0,09
United States 4.50% 06 - 15.02.36	200 000	USD	226 627	213 781	0,03
United States 4.50% 09 - 15.08.39	110 000	USD	128 564	116 772	0,02
United States 4.50% 22 - 15.11.25	416 000	USD	418 156	417 446	0,06
United States 4.50% 23 - 15.07.26	430 000	USD	430 483	434 132	0,06
United States 4.50% 24 - 15.11.33	854 000	USD	864 662	898 435	0,13
United States 4.625% 10 - 15.02.40	140 000	USD	179 418	150 347	0,02
United States 4.625% 23 - 28.02.25	410 000	USD	413 633	409 680	0,06
United States 4.625% 23 - 15.03.26	400 000	USD	407 289	403 594	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.625% 23 - 15.10.26	535 000	USD	537 056	543 150	0,08
United States 4.625% 23 - 15.11.26	558 000	USD	560 443	567 024	0,08
United States 4.75% 07 - 15.02.37	257 300	USD	273 788	282 266	0,04
United States 4.75% 11 - 15.02.41	150 000	USD	166 679	162 703	0,02
United States 4.75% 23 - 15.11.43	334 000	USD	347 063	359 467	0,05
United States 4.75% 24 - 15.11.53	519 000	USD	564 216	584 767	0,09
United States 4.875% 23 - 31.10.28	605 000	USD	619 844	632 083	0,09
United States 4.875% 23 - 30.11.25	830 000	USD	836 107	838 721	0,12
United States 5.00% 07 - 15.05.37	85 000	USD	103 854	95 293	0,01
United States 5.00% 23 - 31.10.25	588 000	USD	587 327	594 776	0,09
United States 5.25% 98 - 15.11.28	89 100	USD	95 199	94 418	0,01
United States 5.25% 99 - 15.02.29	320 000	USD	335 760	339 325	0,05
United States 5.375% 01 - 15.02.31	86 000	USD	94 343	94 089	0,01
United States 6.125% 97 - 15.11.27	100 000	USD	108 739	107 727	0,02
United States 6.25% 00 - 15.05.30	150 000	USD	173 830	169 594	0,03
United States 6.625% 97 - 15.02.27	250 000	USD	280 869	268 418	0,04
UnitedHealth Group Inc. 1.25% 20 - 15.01.26	50 000	USD	48 036	46 844	0,01
UnitedHealth Group Inc. 3.75% 15 - 15.07.25	170 000	USD	169 576	167 623	0,03
UnitedHealth Group Inc. 3.85% 18 - 15.06.28	100 000	USD	100 582	98 026	0,01
UnitedHealth Group Inc. 3.875% 19 - 15.08.59	75 000	USD	67 376	61 399	0,01
UnitedHealth Group Inc. 4.20% 22 - 15.05.32	100 000	USD	101 128	97 915	0,01
UnitedHealth Group Inc. 4.45% 18 - 15.12.48	50 000	USD	49 992	45 918	0,01
UnitedHealth Group Inc. 4.625% 11 - 15.11.41	15 000	USD	15 328	14 385	0,00
UnitedHealth Group Inc. 4.75% 15 - 15.07.45	110 000	USD	113 730	107 296	0,02
UnitedHealth Group Inc. 4.75% 22 - 15.05.52	82 000	USD	82 230	78 963	0,01
UnitedHealth Group Inc. 5.05% 23 - 15.04.53	160 000	USD	158 582	161 997	0,02
UnitedHealth Group Inc. 5.35% 22 - 15.02.33	100 000	USD	100 380	105 886	0,02
UnitedHealth Group Inc. 5.875% 22 - 15.02.53	100 000	USD	103 407	113 375	0,02
UnitedHealth Group Inc. 6.05% 22 - 15.02.63	50 000	USD	56 300	57 974	0,01
US Bancorp 1.375% 20 - 22.07.30	25 000	USD	22 291	20 191	0,00
US Bancorp 1.45% 20 - 12.05.25	40 000	USD	39 283	38 117	0,01
US Bancorp 2.375% 16 - 22.07.26	40 000	USD	39 507	37 569	0,01
US Bancorp FRN 21 - 03.11.36	25 000	USD	22 643	19 595	0,00
US Bancorp FRN 22 - 27.01.33	100 000	USD	81 569	83 587	0,01
US Bancorp 3.00% 19 - 30.07.29	20 000	USD	19 589	18 133	0,00
US Bancorp 3.10% 16 - 27.04.26	100 000	USD	97 127	95 906	0,01
US Bancorp 3.15% 17 - 27.04.27	25 000	USD	25 114	23 798	0,00
US Bancorp 3.90% 18 - 26.04.28	15 000	USD	15 352	14 518	0,00
US Bancorp FRN 22 - 21.10.26	120 000	USD	119 837	120 797	0,02
US Bank NA 2.05% 20 - 21.01.25	75 000	USD	74 502	72 540	0,01
Valero Energy Corp. 3.65% 21 - 01.12.51	20 000	USD	15 781	14 623	0,00
Valero Energy Corp. 4.35% 18 - 01.06.28	50 000	USD	51 281	49 342	0,01
Valero Energy Corp. 7.50% 02 - 15.04.32	25 000	USD	30 330	28 911	0,00
Ventas Realty LP 3.00% 19 - 15.01.30	75 000	USD	72 154	66 327	0,01
VeriSign Inc. 2.70% 21 - 15.06.31	25 000	USD	23 139	21 480	0,00
Verisk Analytics Inc. 4.00% 15 - 15.06.25	25 000	USD	25 200	24 593	0,00
Verizon Communications Inc. 1.375% 17 - 27.10.26	100 000	EUR	105 332	105 686	0,02
Verizon Communications Inc. 1.75% 20 - 20.01.31	125 000	USD	111 771	102 760	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Verizon Communications Inc. 2.10% 21 - 22.03.28	150 000	USD	143 084	135 736	0,02
Verizon Communications Inc. 2.355% 22 - 15.03.32	100 000	USD	91 516	83 255	0,01
Verizon Communications Inc. 2.375% 21 - 22.03.28	10 000	CAD	7 602	6 987	0,00
Verizon Communications Inc. 2.50% 20 - 16.05.30	10 000	CAD	7 377	6 778	0,00
Verizon Communications Inc. 2.625% 16 - 15.08.26	50 000	USD	49 402	47 654	0,01
Verizon Communications Inc. 2.65% 20 - 20.11.40	100 000	USD	85 123	72 237	0,01
Verizon Communications Inc. 2.875% 17 - 15.01.38	100 000	EUR	110 864	102 006	0,02
Verizon Communications Inc. 3.00% 20 - 22.03.27	75 000	USD	74 543	71 374	0,01
Verizon Communications Inc. 3.00% 21 - 23.03.31	200 000	AUD	123 201	114 826	0,02
Verizon Communications Inc. 3.15% 20 - 22.03.30	40 000	USD	39 304	36 628	0,01
Verizon Communications Inc. 3.375% 17 - 27.10.36	100 000	GBP	133 813	109 283	0,02
Verizon Communications Inc. 3.40% 21 - 22.03.41	130 000	USD	103 010	103 884	0,02
Verizon Communications Inc. 3.55% 21 - 22.03.51	100 000	USD	92 027	77 097	0,01
Verizon Communications Inc. 3.70% 21 - 22.03.61	153 000	USD	113 473	116 965	0,02
Verizon Communications Inc. 3.85% 12 - 01.11.42	100 000	USD	98 637	84 181	0,01
Verizon Communications Inc. 4.05% 21 - 22.03.51	10 000	CAD	7 230	6 551	0,00
Verizon Communications Inc. 4.125% 17 - 16.03.27	25 000	USD	24 777	24 660	0,00
Verizon Communications Inc. 4.25% 22 - 31.10.30	100 000	EUR	100 265	117 100	0,02
Verizon Communications Inc. 4.40% 14 - 01.11.34	75 000	USD	70 172	72 381	0,01
Verizon Communications Inc. 4.50% 17 - 10.08.33	50 000	USD	52 915	48 830	0,01
Verizon Communications Inc. 4.522% 15 - 15.09.48	100 000	USD	107 574	91 655	0,01
Verizon Communications Inc. 4.672% 15 - 15.03.55	85 000	USD	93 135	79 207	0,01
Verizon Communications Inc. 4.862% 15 - 21.08.46	100 000	USD	85 504	95 629	0,01
VF Corp. 2.40% 20 - 23.04.25	50 000	USD	49 622	47 763	0,01
VF Corp. 4.125% 23 - 07.03.26	100 000	EUR	105 804	109 279	0,02
Visa Inc. 1.10% 20 - 15.02.31	50 000	USD	44 068	40 615	0,01
Visa Inc. 2.00% 20 - 15.08.50	50 000	USD	36 772	31 043	0,01
Visa Inc. 2.00% 22 - 15.06.29	100 000	EUR	106 371	106 218	0,02
Visa Inc. 2.70% 20 - 15.04.40	25 000	USD	22 713	19 352	0,00
Visa Inc. 2.75% 17 - 15.09.27	40 000	USD	37 685	38 108	0,01
Visa Inc. 3.15% 15 - 14.12.25	50 000	USD	48 772	48 814	0,01
Visa Inc. 4.15% 15 - 14.12.35	25 000	USD	26 838	24 491	0,00
Visa Inc. 4.30% 15 - 14.12.45	75 000	USD	82 018	70 100	0,01
VMware Inc. 1.40% 21 - 15.08.26	25 000	USD	23 780	22 863	0,00
VMware Inc. 2.20% 21 - 15.08.31	25 000	USD	22 329	20 743	0,00
VMware Inc. 3.90% 17 - 21.08.27	25 000	USD	25 192	24 219	0,00
VMware Inc. 4.50% 20 - 15.05.25	25 000	USD	25 373	24 767	0,00
VMware Inc. 4.70% 20 - 15.05.30	25 000	USD	25 990	24 698	0,00
Vulcan Materials Co. 4.50% 17 - 15.06.47	50 000	USD	51 693	45 298	0,01
Walmart Inc. 1.05% 21 - 17.09.26	50 000	USD	48 031	46 005	0,01
Walmart Inc. 1.50% 21 - 22.09.28	50 000	USD	47 092	44 709	0,01
Walmart Inc. 2.50% 21 - 22.09.41	50 000	USD	44 366	37 095	0,01
Walmart Inc. 2.95% 19 - 24.09.49	40 000	USD	37 179	29 959	0,00
Walmart Inc. 3.25% 19 - 08.07.29	25 000	USD	25 529	24 023	0,00
Walmart Inc. 3.55% 18 - 26.06.25	25 000	USD	25 358	24 663	0,00
Walmart Inc. 3.90% 22 - 09.09.25	115 000	USD	114 071	113 974	0,02
Walmart Inc. 3.95% 22 - 09.09.27	140 000	USD	140 002	139 352	0,02
Walmart Inc. 4.00% 23 - 15.04.26	25 000	USD	24 516	24 872	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Walmart Inc. 4.05% 18 - 29.06.48	60 000	USD	53 037	54 998	0,01
Walmart Inc. 4.15% 22 - 09.09.32	50 000	USD	48 243	50 047	0,01
Walmart Inc. 4.875% 09 - 21.09.29	100 000	EUR	130 752	122 921	0,02
Walmart Inc. 5.25% 05 - 01.09.35	25 000	USD	29 555	27 342	0,00
Walmart Inc. 5.625% 09 - 27.03.34	100 000	GBP	145 895	142 767	0,02
Walt Disney Co. 2.00% 19 - 01.09.29	25 000	USD	23 525	22 206	0,00
Walt Disney Co. 2.20% 20 - 13.01.28	25 000	USD	24 173	23 126	0,00
Walt Disney Co. 2.65% 20 - 13.01.31	50 000	USD	48 022	44 518	0,01
Walt Disney Co. 3.057% 20 - 30.03.27	20 000	CAD	15 769	14 653	0,00
Walt Disney Co. 3.50% 20 - 13.05.40	50 000	USD	48 529	42 215	0,01
Walt Disney Co. 3.60% 20 - 13.01.51	40 000	USD	38 790	32 258	0,01
Walt Disney Co. 3.80% 20 - 22.03.30	25 000	USD	25 742	24 316	0,00
Walt Disney Co. 3.80% 20 - 13.05.60	25 000	USD	24 435	20 386	0,00
Walt Disney Co. 4.625% 20 - 23.03.40	80 000	USD	77 236	78 162	0,01
Walt Disney Co. 4.70% 20 - 23.03.50	50 000	USD	49 056	48 660	0,01
Walt Disney Co. 4.75% 19 - 15.09.44	75 000	USD	82 751	72 313	0,01
Walt Disney Co. 6.20% 19 - 15.12.34	50 000	USD	60 795	56 603	0,01
Warnermedia Holdings Inc. 3.755% 23 - 15.03.27	95 000	USD	93 089	91 107	0,01
Warnermedia Holdings Inc. 4.279% 23 - 15.03.32	100 000	USD	94 900	91 607	0,01
Warnermedia Holdings Inc. 5.05% 23 - 15.03.42	60 000	USD	51 513	52 969	0,01
Warnermedia Holdings Inc. 5.141% 23 - 15.03.52	136 000	USD	100 893	117 256	0,02
Warnermedia Holdings Inc. 5.391% 23 - 15.03.62	58 000	USD	52 736	49 986	0,01
Waste Management Inc. 1.15% 20 - 15.03.28	50 000	USD	42 876	44 040	0,01
Waste Management Inc. 2.50% 20 - 15.11.50	40 000	USD	26 382	26 678	0,00
Waste Management Inc. 3.15% 17 - 15.11.27	100 000	USD	96 693	95 904	0,01
Waste Management Inc. 4.15% 19 - 15.07.49	25 000	USD	26 150	22 654	0,00
Welltower Inc. 2.70% 19 - 15.02.27	10 000	USD	9 815	9 402	0,00
Welltower Inc. 2.75% 20 - 15.01.31	10 000	USD	9 454	8 716	0,00
Welltower Inc. 2.75% 21 - 15.01.32	15 000	USD	13 977	12 779	0,00
Welltower Inc. 2.80% 21 - 01.06.31	15 000	USD	14 103	13 112	0,00
Welltower Inc. 3.10% 19 - 15.01.30	25 000	USD	24 253	22 593	0,00
Welltower Inc. 4.125% 19 - 15.03.29	25 000	USD	25 567	24 163	0,00
Welltower Inc. 4.25% 16 - 01.04.26	35 000	USD	35 592	34 486	0,01
Welltower OP LLC 4.00% 15 - 01.06.25	75 000	USD	73 819	73 666	0,01
Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 4.70% 18 - 15.09.28	50 000	USD	49 020	49 501	0,01
Whirlpool Corp. 4.60% 20 - 15.05.50	35 000	USD	36 325	29 606	0,00
Willis North America Inc. 3.875% 19 - 15.09.49	25 000	USD	22 569	19 408	0,00
Workday Inc. 3.70% 22 - 01.04.29	100 000	USD	91 181	96 112	0,01
WP Carey Inc. 2.40% 20 - 01.02.31	20 000	USD	18 336	16 922	0,00
WRKCo Inc. 4.65% 19 - 15.03.26	75 000	USD	76 895	74 512	0,01
WW Grainger Inc. 4.60% 15 - 15.06.45	25 000	USD	27 099	24 171	0,00
Wyeth LLC 5.95% 07 - 01.04.37	50 000	USD	52 953	54 956	0,01
Zoetis Inc. 2.00% 20 - 15.05.30	25 000	USD	22 950	21 568	0,00
Zoetis Inc. 3.00% 17 - 12.09.27	25 000	USD	24 853	23 750	0,00
Zoetis Inc. 4.50% 15 - 13.11.25	25 000	USD	25 580	24 859	0,00
Zoetis Inc. 4.70% 13 - 01.02.43	25 000	USD	27 238	23 937	0,00
			212 991 680	203 467 500	29,73

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Uruguay					
Uruguay 4.125% 12 - 20.11.45	75 000	USD	72 375	68 024	0,01
Uruguay 4.375% 19 - 23.01.31	250 000	USD	271 485	247 843	0,04
Uruguay 4.975% 18 - 20.04.55	110 000	USD	102 751	107 318	0,02
Uruguay 5.10% 14 - 18.06.50	135 000	USD	141 952	135 465	0,02
Uruguay 7.625% 06 - 21.03.36	190 000	USD	239 780	236 470	0,03
			828 343	795 120	0,12
Total - Obligations			610 151 410	577 815 065	84,43
Fonds communs de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Dollar Fund-Z-	99	USD	1 103 455	1 104 414	0,16
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	103	EUR	1 121 024	1 143 435	0,17
			2 224 479	2 247 849	0,33
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			2 224 479	2 247 849	0,33
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			612 375 889	580 062 914	84,76
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations					
Australie					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 144A FRN 20 - 25.11.35	30 000	USD	26 522	24 254	0,00
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 144A FRN 20 - 22.07.30	35 000	USD	34 084	33 291	0,01
Commonwealth Bank of Australia 144A 1.125% 21 - 15.06.26	100 000	USD	91 189	91 827	0,01
Commonwealth Bank of Australia 144A 2.625% 16 - 06.09.26	65 000	USD	64 264	61 670	0,01
Commonwealth Bank of Australia 144A 3.15% 17 - 19.09.27	15 000	USD	14 978	14 237	0,00
Commonwealth Bank of Australia 144A 3.305% 21 - 11.03.41	60 000	USD	52 392	43 481	0,01
Commonwealth Bank of Australia 144A FRN 19 - 12.09.34	75 000	USD	72 075	66 921	0,01
Commonwealth Bank of Australia 144A 3.90% 17 - 12.07.47	50 000	USD	49 436	42 959	0,01
Commonwealth Bank of Australia 144A 3.90% 18 - 16.03.28	20 000	USD	20 473	19 480	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations (suite)					
Australie (suite)					
Macquarie Bank Ltd. 144A 2.30% 20 - 22.01.25	45 000	USD	44 594	43 658	0,01
Macquarie Bank Ltd. 144A FRN 21 - 03.03.36	20 000	USD	17 715	16 179	0,00
Macquarie Bank Ltd. 144A 3.624% 20 - 03.06.30	15 000	USD	14 280	13 086	0,00
Macquarie Bank Ltd. 144A 3.90% 16 - 15.01.26	10 000	USD	10 113	9 788	0,00
National Australia Bank Ltd. 144A 1.887% 22 - 12.01.27	100 000	USD	96 521	92 218	0,01
National Australia Bank Ltd. 144A 2.332% 20 - 21.08.30	30 000	USD	26 829	24 488	0,00
National Australia Bank Ltd. 144A 2.648% 21 - 14.01.41	30 000	USD	23 867	19 560	0,00
National Australia Bank Ltd. 144A 2.99% 21 - 21.05.31	25 000	USD	23 042	20 932	0,00
National Australia Bank Ltd. 144A FRN 19 - 02.08.34	30 000	USD	29 308	27 201	0,01
QBE Insurance Group Ltd. 144A FRN 20 - 31.12.99	30 000	USD	30 636	29 282	0,01
Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 144A 4.375% 20 - 28.05.30	25 000	USD	25 924	23 763	0,00
Scentre Group Trust 2 144A FRN 20 - 24.09.80	90 000	USD	88 991	84 419	0,01
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 144A 3.625% 16 - 28.04.26	100 000	USD	96 714	96 746	0,02
Telstra Corp. Ltd. 144A 3.125% 15 - 07.04.25	50 000	USD	49 086	48 847	0,01
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 144A 2.45% 20 - 16.03.31	25 000	USD	22 807	20 851	0,00
			1 025 840	969 138	0,14
Bermudes					
Triton Container International Ltd. 144A 3.15% 21 - 15.06.31	40 000	USD	37 112	32 051	0,01
			37 112	32 051	0,01
Canada					
Bank of Nova Scotia 144A 1.188% 21 - 13.10.26	350 000	USD	330 835	319 470	0,05
CDP Financial Inc. 144A 1.00% 21 - 26.05.26	350 000	USD	336 989	322 682	0,05
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 144A 2.05% 20 - 10.02.25	30 000	USD	29 615	28 933	0,00
Royal Bank of Canada 144A 1.05% 21 - 14.09.26	325 000	USD	309 102	296 267	0,04
			1 006 541	967 352	0,14
Danemark					
Danske Bank A/S 144A Zero Coupon 21 - 10.09.27	15 000	USD	14 113	13 548	0,00
Danske Bank A/S 144A FRN 20 - 11.09.26	15 000	USD	14 341	14 000	0,00
Danske Bank A/S 144A FRN 23 - 22.09.26	160 000	USD	162 433	162 683	0,03
			190 887	190 231	0,03
Finlande					
Nordea Bank Abp 144A 0.75% 20 - 28.08.25	15 000	USD	14 451	14 007	0,00
Nordea Bank Abp 144A FRN 18 - 13.09.33	10 000	USD	10 180	9 412	0,00
Nordea Bank Abp 144A 5.375% 22 - 22.09.27	50 000	USD	50 312	50 876	0,01
			74 943	74 295	0,01
France					
Air Liquide Finance SA 144A 2.25% 19 - 10.09.29	60 000	USD	57 086	54 772	0,01
AXA SA 144A FRN 06 - 29.12.49	30 000	USD	38 044	32 444	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations (suite)					
France (suite)					
Banque Federative du Credit Mutuel SA 144A 0.998% 21 - 04.02.25	70 000	USD	68 360	66 793	0,01
BNP Paribas 144A FRN 21 - 19.04.32	110 000	USD	93 117	93 243	0,01
BNP Paribas SA 144A FRN 21 - 30.06.27	115 000	USD	108 673	105 344	0,02
BNP Paribas SA 144A FRN 20 - 30.09.28	60 000	USD	55 363	53 291	0,01
BNP Paribas SA 144A FRN 20 - 09.06.26	85 000	USD	82 651	81 160	0,01
BNP Paribas SA 144A FRN 20 - 12.08.35	30 000	USD	26 421	24 557	0,00
BNP Paribas SA 144A 2.824% 21 - 26.01.41	50 000	USD	34 147	34 769	0,01
BNP Paribas SA 144A FRN 20 - 13.01.31	35 000	USD	32 992	30 811	0,01
BNP Paribas SA 144A 4.375% 16 - 12.05.26	20 000	USD	20 118	19 509	0,00
BNP Paribas SA 144A 4.40% 18 - 14.08.28	100 000	USD	97 839	97 512	0,01
BNP Paribas SA 144A FRN 19 - 10.01.30	15 000	USD	15 749	15 029	0,00
BPCE SA 144A 1.00% 21 - 20.01.26	75 000	USD	71 529	69 104	0,01
BPCE SA 144A FRN 20 - 06.10.26	100 000	USD	92 655	93 068	0,01
BPCE SA 144A FRN 21 - 20.01.32	40 000	USD	35 581	32 053	0,01
BPCE SA 144A 2.375% 20 - 14.01.25	95 000	USD	92 448	91 855	0,01
BPCE SA 144A 2.70% 19 - 01.10.29	15 000	USD	14 348	13 239	0,00
BPCE SA 144A FRN 21 - 19.10.32	100 000	USD	78 888	81 103	0,01
BPCE SA 144A FRN 21 - 19.10.42	20 000	USD	17 182	14 191	0,00
BPCE SA 144A 4.625% 18 - 12.09.28	15 000	USD	15 359	14 688	0,00
Credit Agricole SA 144A FRN 21 - 26.01.27	50 000	USD	47 218	46 026	0,01
Credit Agricole SA 144A FRN 20 - 16.06.26	45 000	USD	43 585	42 735	0,01
Credit Agricole SA 144A 2.015% 22 - 11.01.27	80 000	USD	73 456	73 630	0,01
Credit Agricole SA 144A 2.811% 21 - 11.01.41	35 000	USD	29 003	24 087	0,00
Credit Agricole SA 144A 3.25% 20 - 14.01.30	25 000	USD	23 638	22 049	0,00
Danone SA 144A 2.947% 16 - 02.11.26	50 000	USD	46 822	47 774	0,01
Societe Generale SA 144A FRN 22 - 21.01.26	50 000	USD	47 861	48 035	0,01
Societe Generale SA 144A FRN 22 - 19.01.28	30 000	USD	27 309	27 766	0,00
Societe Generale SA 144A FRN 21 - 09.06.32	100 000	USD	90 331	82 593	0,01
Societe Generale SA 144A 3.625% 21 - 01.03.41	25 000	USD	20 823	17 066	0,00
Societe Generale SA 144A FRN 20 - 08.07.35	35 000	USD	32 422	29 583	0,00
Societe Generale SA 144A 4.00% 17 - 12.01.27	35 000	USD	34 818	33 463	0,01
Societe Generale SA 144A FRN 22 - 21.01.43	80 000	USD	60 293	57 413	0,01
Societe Generale SA 144A 4.75% 18 - 14.09.28	15 000	USD	15 253	14 794	0,00
Societe Generale SA 144A FRN 23 - 10.01.29	100 000	USD	102 248	103 625	0,02
Vinci SA 144A 3.75% 19 - 10.04.29	80 000	USD	73 132	77 025	0,01
			1 916 762	1 866 199	0,27
Hong Kong					
AIA Group Ltd. 144A 3.375% 20 - 07.04.30	20 000	USD	19 872	18 440	0,00
			19 872	18 440	0,00
Italie					
Intesa Sanpaolo SpA 144A 7.00% 22 - 21.11.25	50 000	USD	51 244	51 231	0,01
Intesa Sanpaolo SpA 144A 7.80% 23 - 28.11.53	100 000	USD	101 937	110 292	0,02
UniCredit SpA 144A FRN 21 - 03.06.27	30 000	USD	28 078	27 431	0,00
UniCredit SpA 144A FRN 20 - 22.09.26	15 000	USD	14 364	14 115	0,00
UniCredit SpA 144A FRN 21 - 03.06.32	20 000	USD	17 910	16 892	0,00
			213 533	219 961	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations (suite)					
Japon					
Meiji Yasuda Life Insurance Co. 144A FRN 18 - 26.04.48	100 000	USD	93 175	97 742	0,01
Mizuho Financial Group Inc. 144A 3.477% 16 - 12.04.26	80 000	USD	79 917	77 344	0,01
Nissan Motor Co. Ltd. 144A 4.345% 20 - 17.09.27	180 000	USD	167 509	172 278	0,03
NTT Finance Corp. 144A 2.065% 21 - 03.04.31	20 000	USD	18 377	16 734	0,00
			358 978	364 098	0,05
Pays-Bas					
ABN AMRO Bank NV 144A FRN 21 - 13.12.29	100 000	USD	93 344	87 912	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 144A FRN 20 - 24.09.26	60 000	USD	57 143	55 701	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 144A FRN 21 - 15.12.27	40 000	USD	38 118	36 387	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 144A FRN 23 - 28.02.29	160 000	USD	159 206	162 480	0,02
Deutsche Telekom International Finance BV 144A 4.875% 12 - 06.03.42	50 000	USD	53 814	47 873	0,01
ING Groep NV 144A FRN 20 - 01.07.26	90 000	USD	84 940	84 682	0,01
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 1.20% 21 - 11.03.26	90 000	USD	86 481	83 685	0,01
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 1.70% 21 - 11.03.28	20 000	USD	18 882	17 972	0,00
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 2.15% 21 - 11.03.31	30 000	USD	27 968	25 610	0,00
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 2.35% 16 - 15.10.26	30 000	USD	28 372	28 310	0,01
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 2.875% 21 - 11.03.41	35 000	USD	31 238	27 388	0,01
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 3.25% 15 - 27.05.25	25 000	USD	25 094	24 480	0,00
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 3.40% 17 - 16.03.27	20 000	USD	20 146	19 322	0,00
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 4.20% 17 - 16.03.47	35 000	USD	37 162	31 986	0,01
Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A 4.40% 15 - 27.05.45	65 000	USD	70 410	61 300	0,01
			832 318	795 088	0,12
Nouvelle-Zélande					
Bank of New Zealand 144A 2.00% 20 - 21.02.25	15 000	USD	14 827	14 488	0,00
			14 827	14 488	0,00
Norvège					
DNB Bank ASA 144A FRN 21 - 25.05.27	70 000	USD	66 450	63 885	0,01
Yara International ASA 144A 3.148% 20 - 04.06.30	50 000	USD	47 571	43 425	0,01
			114 021	107 310	0,02
Suède					
Skandinaviska Enskilda Banken AB 144A 0.85% 20 - 02.09.25	25 000	USD	24 138	23 365	0,00
Skandinaviska Enskilda Banken AB 144A 1.20% 21 - 09.09.26	15 000	USD	14 302	13 637	0,00
Svenska Handelsbanken AB 144A FRN 21 - 11.06.27	30 000	USD	28 519	27 288	0,01
			66 959	64 290	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations (suite)					
Suisse					
UBS Group AG 144A FRN 21 - 02.02.27	35 000	USD	31 582	32 075	0,00
UBS Group AG 144A FRN 20 - 30.01.27	50 000	USD	45 352	45 853	0,01
UBS Group AG 144A FRN 20 - 05.06.26	130 000	USD	125 467	123 696	0,02
UBS Group AG 144A FRN 21 - 14.05.32	80 000	USD	73 154	68 200	0,01
UBS Group AG 144A FRN 18 - 12.01.29	35 000	USD	34 369	33 043	0,01
UBS Group AG 144A 4.125% 15 - 24.09.25	100 000	USD	98 731	97 779	0,01
UBS Group AG 144A 4.125% 16 - 15.04.26	80 000	USD	80 848	78 046	0,01
UBS Group AG 144A FRN 20 - 01.04.31	55 000	USD	54 214	51 308	0,01
UBS Group AG 144A 4.282% 17 - 09.01.28	50 000	USD	47 287	48 380	0,01
UBS Group AG 144A FRN 22 - 12.08.33	150 000	USD	153 266	160 159	0,02
			744 270	738 539	0,11
Royaume-Uni					
Standard Chartered PLC 144A FRN 20 - 01.04.31	35 000	USD	35 688	33 046	0,01
			35 688	33 046	0,01
États-Unis					
Alcon Finance Corp. 144A 2.75% 19 - 23.09.26	55 000	USD	54 079	51 718	0,01
Aviation Capital Group LLC 144A 1.95% 21 - 20.09.26	50 000	USD	47 185	45 359	0,01
Aviation Capital Group LLC 144A 3.50% 17 - 01.11.27	100 000	USD	90 076	92 133	0,01
Berry Global Inc. 144A 4.875% 19 - 15.07.26	50 000	USD	48 293	49 263	0,01
BMW US Capital LLC 144A 2.80% 16 - 11.04.26	50 000	USD	49 671	48 041	0,01
BMW US Capital LLC 144A 3.75% 18 - 12.04.28	25 000	USD	25 426	24 176	0,00
BMW US Capital LLC 144A 4.15% 20 - 09.04.30	25 000	USD	25 814	24 506	0,00
BMW US Capital LLC 144A 5.05% 23 - 11.08.28	75 000	USD	74 551	76 489	0,01
Broadcom Inc. 144A 2.60% 21 - 15.02.33	100 000	USD	82 881	82 451	0,01
Broadcom Inc. 144A 3.137% 21 - 15.11.35	80 000	USD	66 869	65 778	0,01
Broadcom Inc. 144A 3.469% 21 - 15.04.34	270 000	USD	227 029	235 348	0,03
Broadcom Inc. 144A 3.50% 21 - 15.02.41	100 000	USD	80 510	79 523	0,01
Cargill Inc. 144A 2.125% 21 - 10.11.31	50 000	USD	45 815	41 748	0,01
Cargill Inc. 144A 4.375% 22 - 22.04.52	100 000	USD	85 493	91 818	0,01
Cargill Inc. 144A 4.76% 15 - 23.11.45	50 000	USD	56 351	47 892	0,01
Carrier Global Corp. 144A 5.80% 23 - 30.11.25	50 000	USD	50 324	50 700	0,01
Corebridge Global Funding 144A 0.90% 20 - 22.09.25	30 000	USD	28 847	27 897	0,00
CRH America Finance Inc. 144A 3.40% 17 - 09.05.27	50 000	USD	47 374	47 781	0,01
CRH America Finance Inc. 144A 3.95% 18 - 04.04.28	75 000	USD	76 080	72 541	0,01
Daimler Truck Finance North America LLC 144A 2.50% 21 - 14.12.31	60 000	USD	48 082	49 802	0,01
Daimler Trucks Finance North America LLC 144A 2.00% 21 - 14.12.26	70 000	USD	66 546	64 431	0,01
Delta Air Lines Inc. / SkyMiles IP Ltd. 144A 4.50% 20 - 20.10.25	66 666	USD	65 679	65 770	0,01
Delta Air Lines Inc. / SkyMiles IP Ltd. 144A 4.75% 20 - 20.10.28	25 000	USD	25 154	24 573	0,00
EMD Finance LLC 144A 3.25% 15 - 19.03.25	25 000	USD	25 077	24 406	0,00
Empower Finance 2020 LP 144A 3.075% 20 - 17.09.51	50 000	USD	41 905	34 695	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Equitable Financial Life Global Funding 144A 1.30% 21 - 12.07.26	70 000	USD	66 771	63 142	0,01
ERAC USA Finance LLC 144A 3.30% 16 - 01.12.26	80 000	USD	76 613	76 597	0,01
ERAC USA Finance LLC 144A 3.80% 15 - 01.11.25	25 000	USD	25 274	24 400	0,00
ERAC USA Finance LLC 144A 5.625% 12 - 15.03.42	50 000	USD	57 433	52 087	0,01
ERAC USA Finance LLC 144A 7.00% 07 - 15.10.37	25 000	USD	31 802	29 217	0,00
Fannie Mae Pool 1.50% 21 - 01.11.41	128 548	USD	103 714	106 268	0,02
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.02.52	276 144	USD	218 763	225 752	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.03.52	278 843	USD	220 607	227 712	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.04.52	184 173	USD	145 816	150 401	0,02
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.02.52	228 532	USD	178 093	186 896	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 23 - 01.08.37	225 156	USD	199 067	201 586	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 23 - 01.05.52	296 391	USD	241 818	242 461	0,04
Fannie Mae Pool 2.00% 23 - 01.03.37	198 148	USD	176 275	178 056	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 23 - 01.10.50	298 579	USD	247 144	245 607	0,04
Fannie Mae Pool 2.50% 23 - 01.07.53	241 806	USD	200 983	207 485	0,03
Fannie Mae Pool 2.50% 23 - 01.05.52	147 278	USD	123 892	125 352	0,02
Fannie Mae Pool 2.50% 23 - 01.03.52	197 125	USD	163 846	168 840	0,02
Fannie Mae Pool 3.00% 22 - 01.11.52	279 582	USD	246 472	247 237	0,04
Fannie Mae Pool 3.00% 22 - 01.11.52	135 975	USD	118 848	121 798	0,02
Fannie Mae Pool 3.00% 22 - 01.04.51	185 083	USD	160 330	165 468	0,02
Fannie Mae Pool 3.00% 23 - 01.04.52	193 217	USD	165 582	170 863	0,03
Fannie Mae Pool 4.00% 23 - 01.03.53	175 154	USD	163 005	165 704	0,02
Fannie Mae Pool 4.50% 23 - 01.04.50	178 919	USD	171 155	177 655	0,03
Fannie Mae Pool 5.00% 22 - 01.08.52	226 302	USD	222 000	224 016	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.02.53	189 044	USD	189 080	190 849	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.05.53	189 851	USD	188 430	190 738	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.06.53	191 867	USD	190 968	192 764	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.07.53	143 727	USD	143 052	144 513	0,02
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.07.53	194 636	USD	190 722	195 835	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.08.53	194 746	USD	192 037	195 657	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.10.53	98 962	USD	93 998	99 424	0,01
Fannie Mae Pool 6.00% 23 - 01.06.53	144 858	USD	146 372	147 467	0,02
Fannie Mae Pool 6.00% 23 - 01.08.53	192 192	USD	193 658	195 186	0,03
Fannie Mae Pool 6.00% 23 - 01.08.53	190 495	USD	187 268	196 214	0,03
Fannie Mae Pool 6.00% 23 - 01.10.53	249 667	USD	251 467	254 903	0,04
Fannie Mae Pool 6.00% 23 - 01.11.53	198 567	USD	201 972	201 669	0,03
Fannie Mae Pool 6.50% 23 - 01.08.53	191 518	USD	194 590	196 145	0,03
Fannie Mae Pool 6.50% 23 - 01.12.53	198 478	USD	203 812	203 273	0,03
Fannie Mae Pool 7.00% 23 - 01.08.53	140 195	USD	144 019	144 495	0,02
Fresenius Medical Care US Finance III Inc. 144A 3.75% 19 - 15.06.29	60 000	USD	58 971	52 639	0,01
Great-West Lifeco US Finance 2020 LP 144A 0.904% 20 - 12.08.25	50 000	USD	48 422	46 431	0,01
Harley-Davidson Financial Services Inc. 144A 3.35% 20 - 08.06.25	100 000	USD	95 880	96 539	0,01
Holcim Finance US LLC 144A 4.75% 16 - 22.09.46	25 000	USD	26 520	22 448	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
International Flavors & Fragrances Inc. 144A 1.23% 20 - 01.10.25	25 000	USD	24 112	23 148	0,00
International Flavors & Fragrances Inc. 144A 1.832% 20 - 15.10.27	25 000	USD	23 429	21 941	0,00
International Flavors & Fragrances Inc. 144A 2.30% 20 - 01.11.30	25 000	USD	22 788	20 771	0,00
International Flavors & Fragrances Inc. 144A 3.268% 20 - 15.11.40	25 000	USD	22 133	18 003	0,00
International Flavors & Fragrances Inc. 144A 3.468% 20 - 01.12.50	50 000	USD	43 745	34 284	0,01
Liberty Mutual Group Inc. 144A 3.951% 19 - 15.10.50	90 000	USD	67 799	68 466	0,01
Massachusetts Mutual Life Insurance Co. 144A 3.729% 19 - 15.10.70	50 000	USD	35 160	34 406	0,01
MassMutual Global Funding II 144A 1.55% 20 - 09.10.30	70 000	USD	54 691	56 731	0,01
MasTec Inc. 144A 4.50% 20 - 15.08.28	40 000	USD	38 455	37 621	0,01
Mercedes-Benz Finance North America LLC 144A 1.45% 21 - 02.03.26	25 000	USD	24 074	23 317	0,00
Mercedes-Benz Finance North America LLC 144A 2.45% 21 - 02.03.31	50 000	USD	46 479	43 399	0,01
Mercedes-Benz Finance North America LLC 144A 3.10% 19 - 15.08.29	25 000	USD	24 463	23 158	0,00
Mercedes-Benz Finance North America LLC 144A 3.50% 15 - 03.08.25	25 000	USD	25 087	24 520	0,00
Mercedes-Benz Finance North America LLC 144A 3.75% 18 - 22.02.28	25 000	USD	25 242	24 199	0,00
Mercedes-Benz Finance North America LLC 144A 4.80% 23 - 30.03.28	50 000	USD	49 823	50 537	0,01
Mercedes-Benz Finance North America LLC 144A 5.375% 22 - 26.11.25	50 000	USD	50 017	50 520	0,01
Metropolitan Life Global Funding I 144A 0.95% 20 - 02.07.25	30 000	USD	29 162	28 289	0,00
Metropolitan Life Global Funding I 144A 1.55% 21 - 07.01.31	35 000	USD	29 431	28 060	0,00
Metropolitan Life Global Funding I 144A 2.80% 22 - 21.03.25	80 000	USD	77 270	77 890	0,01
Metropolitan Life Global Funding I 144A 3.00% 17 - 19.09.27	15 000	USD	14 795	14 069	0,00
Metropolitan Life Global Funding I 144A 3.05% 19 - 17.06.29	30 000	USD	29 478	27 371	0,00
Metropolitan Life Global Funding I 144A 3.45% 16 - 18.12.26	15 000	USD	15 078	14 435	0,00
Microsoft Corp. 144A 3.40% 23 - 15.09.26	25 000	USD	25 298	24 362	0,00
National Securities Clearing Corp. 144A 1.50% 20 - 23.04.25	70 000	USD	68 816	67 063	0,01
Nestle Holdings Inc. 144A 0.625% 20 - 15.01.26	30 000	USD	28 752	27 741	0,00
Nestle Holdings Inc. 144A 1.00% 20 - 15.09.27	140 000	USD	127 369	124 810	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations (suite)					
États-Unis (suite)					
Nestle Holdings Inc. 144A 1.25% 20 - 15.09.30	25 000	USD	22 324	20 714	0,00
Nestle Holdings Inc. 144A 1.875% 21 - 14.09.31	25 000	USD	22 899	21 003	0,00
Nestle Holdings Inc. 144A 3.625% 18 - 24.09.28	45 000	USD	45 811	43 827	0,01
Nestle Holdings Inc. 144A 3.90% 18 - 24.09.38	40 000	USD	41 506	36 738	0,01
Nestle Holdings Inc. 144A 4.00% 18 - 24.09.48	60 000	USD	63 199	53 806	0,01
Nestle Holdings Inc. 144A 4.25% 22 - 01.10.29	50 000	USD	49 622	49 996	0,01
New York Life Global Funding 144A 0.85% 21 - 15.01.26	100 000	USD	91 509	92 459	0,01
New York Life Global Funding 144A 3.60% 22 - 05.08.25	50 000	USD	48 741	49 166	0,01
New York Life Insurance Co. 144A 5.875% 03 - 15.05.33	100 000	USD	103 445	106 219	0,02
Newmont Corp. / Newcrest Finance Pty Ltd. 144A 4.20% 23 - 13.05.50	35 000	USD	33 830	30 029	0,00
Principal Life Global Funding II 144A 1.25% 21 - 16.08.26	40 000	USD	35 877	36 292	0,01
Principal Life Global Funding II 144A 3.00% 16 - 18.04.26	25 000	USD	24 893	23 838	0,00
Qorvo Inc. 144A 3.375% 20 - 01.04.31	25 000	USD	23 126	21 492	0,00
Roche Holdings Inc. 144A 1.93% 21 - 13.12.28	50 000	USD	47 446	44 669	0,01
Roche Holdings Inc. 144A 2.076% 21 - 13.12.31	40 000	USD	37 173	33 718	0,00
Roche Holdings Inc. 144A 2.607% 21 - 13.12.51	50 000	USD	42 666	33 764	0,01
Roche Holdings Inc. 144A 3.00% 15 - 10.11.25	75 000	USD	75 353	72 958	0,01
Roche Holdings Inc. 144A 7.00% 09 - 01.03.39	40 000	USD	56 125	49 551	0,01
Sabal Trail Transmission LLC 144A 4.682% 18 - 01.05.38	25 000	USD	26 714	23 481	0,00
SC Johnson & Son Inc. 144A 4.75% 15 - 15.10.46	30 000	USD	34 225	27 884	0,00
Smithfield Foods Inc. 144A 4.25% 17 - 01.02.27	50 000	USD	50 378	48 025	0,01
WEA Finance LLC 144A 2.875% 19 - 15.01.27	50 000	USD	48 505	44 568	0,01
			10 249 965	10 223 936	1,49
Total - Obligations			16 902 516	16 678 462	2,44

Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires

États-Unis

Fannie Mae Pool 1.50% 21 - 01.02.41	152 470	USD	122 497	127 104	0,02
Fannie Mae Pool 1.50% 21 - 01.04.36	339 127	USD	313 248	296 725	0,04
Fannie Mae Pool 1.50% 21 - 01.04.41	163 444	USD	145 255	135 525	0,02
Fannie Mae Pool 1.50% 21 - 01.05.51	241 306	USD	191 332	188 152	0,03
Fannie Mae Pool 1.50% 21 - 01.09.51	89 290	USD	70 063	69 486	0,01
Fannie Mae Pool 1.50% 21 - 01.10.51	814 363	USD	733 217	634 534	0,09
Fannie Mae Pool 1.50% 21 - 01.11.36	40 328	USD	38 536	35 201	0,01
Fannie Mae Pool 1.50% 22 - 01.03.37	211 000	USD	189 650	183 984	0,03
Fannie Mae Pool 1.50% 22 - 01.02.36	215 525	USD	191 841	188 180	0,03
Fannie Mae Pool 1.50% 22 - 01.10.36	272 671	USD	252 330	238 005	0,04
Fannie Mae Pool 1.50% 22 - 01.05.37	129 518	USD	113 139	112 935	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Fannie Mae Pool 1.50% 22 - 01.11.37	128 145	USD	113 195	113 613	0,02
Fannie Mae Pool 1.50% 22 - 01.04.36	326 640	USD	289 871	285 198	0,04
Fannie Mae Pool 2.00% 20 - 01.05.35	302 106	USD	286 488	271 963	0,04
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.09.35	171 767	USD	155 589	154 489	0,02
Fannie Mae Pool 2.00% 20 - 01.09.50	742 842	USD	695 378	611 052	0,09
Fannie Mae Pool 2.00% 20 - 01.11.50	251 316	USD	202 841	205 207	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.01.51	153 765	USD	130 763	127 263	0,02
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.02.51	1 341 396	USD	1 223 312	1 101 751	0,16
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.04.51	363 064	USD	321 806	298 005	0,04
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.05.51	370 523	USD	307 958	303 621	0,04
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.05.36	206 553	USD	187 167	185 710	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.07.51	127 485	USD	118 974	104 407	0,02
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.08.51	579 451	USD	482 051	474 519	0,07
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.09.51	259 433	USD	232 488	212 348	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.11.36	274 644	USD	259 282	246 485	0,04
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.04.51	291 899	USD	246 509	239 330	0,04
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.11.51	1 251 267	USD	1 166 937	1 025 003	0,15
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.12.36	135 959	USD	123 550	121 983	0,02
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.01.37	160 444	USD	151 615	143 907	0,02
Fannie Mae Pool 2.00% 21 - 01.12.51	906 508	USD	845 669	742 315	0,11
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.01.42	113 802	USD	99 301	97 810	0,01
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.02.52	315 205	USD	262 275	258 572	0,04
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.02.42	223 411	USD	192 110	192 016	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.02.52	1 360 886	USD	1 268 523	1 112 313	0,16
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.03.52	821 422	USD	698 895	670 798	0,10
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.04.37	168 765	USD	159 153	151 099	0,02
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.03.52	104 845	USD	97 758	85 743	0,01
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.04.52	1 315 585	USD	1 145 499	1 074 345	0,16
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.05.37	87 196	USD	83 060	78 068	0,01
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.08.51	477 842	USD	402 035	391 527	0,06
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.12.36	82 437	USD	77 863	74 055	0,01
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.02.36	216 564	USD	199 119	194 663	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 22 - 01.08.37	223 350	USD	201 956	199 969	0,03
Fannie Mae Pool 2.00% 23 - 01.07.51	379 494	USD	320 872	312 167	0,05
Fannie Mae Pool 2.50% 13 - 01.05.43	52 593	USD	51 240	46 553	0,01
Fannie Mae Pool 2.50% 15 - 01.04.30	75 867	USD	75 732	72 043	0,01
Fannie Mae Pool 2.50% 15 - 01.05.30	111 094	USD	110 896	105 605	0,02
Fannie Mae Pool 2.50% 16 - 01.08.31	45 053	USD	44 956	42 503	0,01
Fannie Mae Pool 2.50% 16 - 01.08.31	68 791	USD	68 644	64 934	0,01
Fannie Mae Pool 2.50% 16 - 01.11.31	124 999	USD	124 729	117 816	0,02
Fannie Mae Pool 2.50% 17 - 01.02.32	136 237	USD	135 941	128 030	0,02
Fannie Mae Pool 2.50% 17 - 01.04.31	215 110	USD	214 137	206 516	0,03
Fannie Mae Pool 2.50% 18 - 01.05.30	219 351	USD	218 752	209 826	0,03
Fannie Mae Pool 2.50% 19 - 01.03.29	30 882	USD	30 752	29 658	0,00
Fannie Mae Pool 2.50% 19 - 01.12.37	373 968	USD	366 113	343 790	0,05
Fannie Mae Pool 2.50% 20 - 01.01.51	375 019	USD	347 308	319 568	0,05
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.02.51	394 793	USD	366 175	338 046	0,05
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.04.51	397 820	USD	368 855	338 927	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.05.41	235 789	USD	229 281	210 134	0,03
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.05.51	400 995	USD	371 690	343 373	0,05
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.05.51	410 969	USD	380 935	350 113	0,05
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.05.51	171 785	USD	151 326	146 210	0,02
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.06.51	1 085 189	USD	1 038 918	928 070	0,14
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.06.51	193 526	USD	179 057	165 459	0,02
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.06.51	499 424	USD	462 919	427 175	0,06
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.07.51	490 644	USD	454 178	419 898	0,06
Fannie Mae Pool 2.50% 21 - 01.12.51	302 761	USD	265 552	258 475	0,04
Fannie Mae Pool 2.50% 22 - 01.02.52	436 021	USD	376 733	372 027	0,05
Fannie Mae Pool 2.50% 22 - 01.04.52	821 314	USD	712 380	699 361	0,10
Fannie Mae Pool 2.50% 22 - 01.01.52	355 900	USD	330 241	304 371	0,04
Fannie Mae Pool 2.50% 22 - 01.12.37	158 091	USD	148 613	145 937	0,02
Fannie Mae Pool 2.50% 22 - 01.02.52	288 168	USD	252 703	246 303	0,04
Fannie Mae Pool 2.50% 23 - 01.07.52	227 104	USD	200 874	193 772	0,03
Fannie Mae Pool 3.00% 12 - 01.10.32	91 102	USD	91 277	86 409	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 12 - 01.01.33	36 839	USD	36 910	34 890	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 13 - 01.01.43	318 913	USD	318 451	290 540	0,04
Fannie Mae Pool 3.00% 13 - 01.04.33	80 485	USD	80 642	76 441	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 15 - 01.09.35	47 038	USD	47 058	44 167	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 16 - 01.08.46	249 657	USD	248 162	225 611	0,03
Fannie Mae Pool 3.00% 16 - 01.09.46	291 812	USD	290 064	263 706	0,04
Fannie Mae Pool 3.00% 16 - 01.09.46	91 414	USD	90 866	82 609	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 16 - 01.10.46	59 298	USD	58 942	53 586	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 16 - 01.11.36	52 604	USD	52 786	49 507	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 16 - 01.10.46	316 103	USD	314 208	285 657	0,04
Fannie Mae Pool 3.00% 16 - 01.10.46	335 037	USD	333 028	302 767	0,04
Fannie Mae Pool 3.00% 16 - 01.11.46	83 726	USD	83 224	75 654	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 17 - 01.02.47	49 578	USD	49 281	44 798	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 17 - 01.02.47	127 165	USD	126 402	114 905	0,02
Fannie Mae Pool 3.00% 17 - 01.07.32	54 982	USD	55 620	52 355	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 17 - 01.08.32	41 738	USD	42 222	39 770	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 17 - 01.09.32	60 116	USD	60 815	57 261	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 17 - 01.01.33	48 473	USD	49 040	46 061	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 18 - 01.02.33	71 964	USD	72 808	68 332	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 18 - 01.02.48	53 337	USD	52 912	48 152	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 18 - 01.03.33	44 063	USD	44 489	41 804	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 18 - 01.03.48	149 020	USD	147 832	134 527	0,02
Fannie Mae Pool 3.00% 18 - 01.03.30	34 181	USD	34 429	33 357	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 19 - 01.04.47	293 538	USD	291 776	265 238	0,04
Fannie Mae Pool 3.00% 19 - 01.11.49	122 120	USD	110 469	109 388	0,02
Fannie Mae Pool 3.00% 19 - 01.12.34	183 721	USD	175 711	174 243	0,03
Fannie Mae Pool 3.00% 20 - 01.01.35	79 099	USD	80 050	75 477	0,01
Fannie Mae Pool 3.00% 20 - 01.12.48	133 577	USD	132 510	120 591	0,02
Fannie Mae Pool 3.00% 20 - 01.08.50	399 639	USD	393 176	354 139	0,05
Fannie Mae Pool 3.00% 20 - 01.10.50	145 316	USD	132 678	128 727	0,02
Fannie Mae Pool 3.00% 21 - 01.01.52	242 906	USD	218 767	214 804	0,03
Fannie Mae Pool 3.00% 22 - 01.03.52	133 269	USD	121 247	117 928	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Fannie Mae Pool 3.00% 22 - 01.03.52	225 773	USD	205 576	199 784	0,03
Fannie Mae Pool 3.00% 22 - 01.05.52	184 199	USD	175 761	162 967	0,02
Fannie Mae Pool 3.50% 17 - 01.10.47	90 480	USD	91 040	85 384	0,01
Fannie Mae Pool 3.50% 19 - 01.06.49	272 681	USD	267 693	256 471	0,04
Fannie Mae Pool 3.50% 20 - 01.09.32	63 654	USD	64 836	62 432	0,01
Fannie Mae Pool 3.50% 20 - 01.01.49	101 229	USD	102 364	94 863	0,01
Fannie Mae Pool 3.50% 20 - 01.04.48	355 457	USD	359 432	333 102	0,05
Fannie Mae Pool 3.50% 20 - 01.11.35	89 045	USD	89 540	86 381	0,01
Fannie Mae Pool 3.50% 21 - 01.11.48	152 487	USD	151 679	142 182	0,02
Fannie Mae Pool 3.50% 21 - 01.07.47	317 584	USD	321 705	298 136	0,04
Fannie Mae Pool 3.50% 21 - 01.08.43	150 151	USD	150 325	141 573	0,02
Fannie Mae Pool 3.50% 21 - 01.12.51	48 030	USD	48 190	44 160	0,01
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.03.52	252 192	USD	253 062	231 849	0,03
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.07.50	151 584	USD	151 248	141 971	0,02
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.04.52	137 221	USD	128 015	126 310	0,02
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.10.51	239 520	USD	234 301	223 199	0,03
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.05.52	453 953	USD	454 856	417 193	0,06
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.06.52	137 895	USD	129 660	126 707	0,02
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.06.52	453 296	USD	419 891	416 516	0,06
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.11.37	132 036	USD	127 370	127 120	0,02
Fannie Mae Pool 3.50% 22 - 01.07.52	325 805	USD	306 072	300 336	0,04
Fannie Mae Pool 4.00% 10 - 01.10.30	22 053	USD	22 715	21 598	0,00
Fannie Mae Pool 4.00% 10 - 01.12.30	15 046	USD	15 500	14 735	0,00
Fannie Mae Pool 4.00% 18 - 01.05.48	50 937	USD	52 596	49 055	0,01
Fannie Mae Pool 4.00% 18 - 01.06.48	297 656	USD	307 352	286 662	0,04
Fannie Mae Pool 4.00% 18 - 01.08.48	206	USD	213	199	0,00
Fannie Mae Pool 4.00% 18 - 01.08.48	236 430	USD	244 136	227 698	0,03
Fannie Mae Pool 4.00% 18 - 01.09.48	272 474	USD	254 052	261 965	0,04
Fannie Mae Pool 4.00% 18 - 01.09.48	302 965	USD	312 841	291 775	0,04
Fannie Mae Pool 4.00% 19 - 01.03.49	100 185	USD	103 392	96 481	0,01
Fannie Mae Pool 4.00% 19 - 01.06.49	108 655	USD	112 136	104 638	0,02
Fannie Mae Pool 4.00% 19 - 01.12.49	36 576	USD	37 749	35 224	0,01
Fannie Mae Pool 4.00% 20 - 01.03.50	394 805	USD	406 910	379 858	0,06
Fannie Mae Pool 4.00% 20 - 01.04.50	73 330	USD	75 403	70 119	0,01
Fannie Mae Pool 4.00% 21 - 01.06.51	91 481	USD	93 651	86 831	0,01
Fannie Mae Pool 4.00% 21 - 01.10.51	100 225	USD	102 690	95 083	0,01
Fannie Mae Pool 4.00% 22 - 01.05.51	128 807	USD	124 849	123 839	0,02
Fannie Mae Pool 4.00% 22 - 01.10.52	247 080	USD	235 162	233 864	0,03
Fannie Mae Pool 4.00% 22 - 01.12.37	65 116	USD	64 111	63 909	0,01
Fannie Mae Pool 4.00% 23 - 01.02.53	133 637	USD	128 733	126 447	0,02
Fannie Mae Pool 4.50% 14 - 01.08.44	77 914	USD	77 496	77 671	0,01
Fannie Mae Pool 4.50% 17 - 01.11.47	177 269	USD	185 640	176 308	0,03
Fannie Mae Pool 4.50% 18 - 01.05.48	66 085	USD	69 585	65 837	0,01
Fannie Mae Pool 4.50% 19 - 01.08.49	261 594	USD	271 388	257 373	0,04
Fannie Mae Pool 4.50% 20 - 01.05.50	178 971	USD	187 924	175 240	0,03
Fannie Mae Pool 4.50% 21 - 01.09.50	15 262	USD	15 841	15 046	0,00
Fannie Mae Pool 4.50% 22 - 01.07.52	268 399	USD	268 680	260 512	0,04
Fannie Mae Pool 4.50% 22 - 01.08.37	55 279	USD	55 156	54 996	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Fannie Mae Pool 4.50% 22 - 01.08.52	175 307	USD	170 695	170 123	0,03
Fannie Mae Pool 4.50% 22 - 01.09.52	137 944	USD	135 026	133 861	0,02
Fannie Mae Pool 4.50% 22 - 01.10.52	194 849	USD	190 664	189 087	0,03
Fannie Mae Pool 4.50% 22 - 01.10.52	187 376	USD	176 690	181 834	0,03
Fannie Mae Pool 5.00% 03 - 01.08.33	83 849	USD	83 197	84 568	0,01
Fannie Mae Pool 5.00% 06 - 01.03.36	178 299	USD	185 962	180 297	0,03
Fannie Mae Pool 5.00% 10 - 01.03.40	70 382	USD	70 136	71 636	0,01
Fannie Mae Pool 5.00% 19 - 01.05.49	80 103	USD	84 515	80 606	0,01
Fannie Mae Pool 5.00% 22 - 01.08.52	309 080	USD	313 297	305 958	0,04
Fannie Mae Pool 5.00% 22 - 01.08.52	177 840	USD	176 162	176 044	0,03
Fannie Mae Pool 5.00% 22 - 01.12.52	283 781	USD	284 862	280 914	0,04
Fannie Mae Pool 5.00% 23 - 01.02.53	236 525	USD	234 401	234 121	0,03
Fannie Mae Pool 5.00% 23 - 01.03.53	199 827	USD	198 852	197 795	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 22 - 01.06.52	174 538	USD	172 547	175 710	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 22 - 01.08.52	165 727	USD	168 763	167 081	0,02
Fannie Mae Pool 5.50% 22 - 01.09.52	181 155	USD	185 806	185 120	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 22 - 01.12.52	124 167	USD	125 316	124 862	0,02
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.01.52	231 564	USD	232 727	232 818	0,03
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.12.52	136 789	USD	137 314	137 630	0,02
Fannie Mae Pool 5.50% 23 - 01.03.53	121 452	USD	122 895	122 020	0,02
Fannie Mae Pool 6.00% 22 - 01.09.52	82 177	USD	84 324	83 672	0,01
Fannie Mae Pool 6.00% 22 - 01.10.52	136 953	USD	141 969	140 507	0,02
Fannie Mae Pool 6.00% 22 - 01.11.52	92 898	USD	96 050	94 380	0,01
Fannie Mae Pool 6.00% 22 - 01.12.52	337 554	USD	343 654	342 826	0,05
Fannie Mae Pool 6.00% 23 - 01.02.53	124 194	USD	126 584	126 134	0,02
Fannie Mae Pool 6.50% 22 - 01.12.52	129 539	USD	132 955	132 680	0,02
Fannie Mae Pool 6.50% 23 - 01.04.53	181 313	USD	185 564	185 694	0,03
Fannie Mae-Aces-A2- FRN 21 - 25.11.30	200 000	USD	183 611	165 352	0,02
Fannie Mae-Aces-A2- FRN 17 - 25.10.26	146 599	USD	143 439	138 997	0,02
Fannie Mae-Aces-A2- FRN 17 - 25.02.27	141 240	USD	135 074	135 512	0,02
Fannie Mae-Aces-A2- 3.143% 19 - 25.04.29	247 798	USD	251 463	234 030	0,03
Fannie Mae-Aces-A2- 3.273% 19 - 25.02.29	243 706	USD	248 474	232 748	0,03
Freddie Mac Gold Pool 2.00% 17 - 01.02.32	313 266	USD	306 389	290 835	0,04
Freddie Mac Gold Pool 2.50% 15 - 01.03.30	91 340	USD	91 222	86 878	0,01
Freddie Mac Gold Pool 2.50% 15 - 01.10.30	59 098	USD	59 020	56 022	0,01
Freddie Mac Gold Pool 2.50% 16 - 01.10.31	61 786	USD	61 679	58 458	0,01
Freddie Mac Gold Pool 2.50% 16 - 01.12.31	102 890	USD	102 720	96 955	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 12 - 01.08.42	295 714	USD	293 390	269 730	0,04
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 12 - 01.11.27	40 501	USD	40 802	39 308	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 13 - 01.01.33	91 398	USD	91 622	86 634	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 15 - 01.05.35	81 172	USD	81 255	76 330	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 16 - 01.04.31	42 864	USD	43 378	41 074	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 16 - 01.10.46	165 373	USD	164 490	149 620	0,02
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 16 - 01.01.47	251 769	USD	250 423	227 766	0,03
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 17 - 01.06.32	86 614	USD	87 663	82 563	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.00% 18 - 01.03.33	98 701	USD	99 906	93 830	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 11 - 01.01.41	206 186	USD	208 949	194 752	0,03
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 12 - 01.06.32	25 770	USD	26 249	24 842	0,00

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 12 - 01.08.42	56 889	USD	58 172	54 099	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 15 - 01.06.45	179 062	USD	168 543	168 985	0,02
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 15 - 01.01.29	31 473	USD	32 008	30 901	0,00
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 16 - 01.09.46	78 127	USD	79 153	73 646	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 16 - 01.12.46	87 136	USD	88 316	81 898	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 17 - 01.11.37	56 613	USD	57 767	54 319	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 17 - 01.10.47	107 625	USD	109 803	101 535	0,02
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 18 - 01.09.32	35 230	USD	35 908	34 380	0,01
Freddie Mac Gold Pool 3.50% 23 - 01.07.53	192 390	USD	174 959	179 592	0,03
Freddie Mac Gold Pool 4.00% 10 - 01.12.40	46 411	USD	44 777	45 170	0,01
Freddie Mac Gold Pool 4.00% 14 - 01.04.44	43 289	USD	41 199	42 058	0,01
Freddie Mac Gold Pool 4.00% 17 - 01.06.37	24 369	USD	25 197	23 853	0,00
Freddie Mac Gold Pool 4.00% 18 - 01.01.29	10 360	USD	10 586	10 225	0,00
Freddie Mac Gold Pool 4.00% 18 - 01.10.48	138 235	USD	131 223	133 059	0,02
Freddie Mac Gold Pool 4.50% 15 - 01.11.45	267 031	USD	257 961	265 089	0,04
Freddie Mac Gold Pool 5.00% 09 - 01.07.39	173 140	USD	181 111	176 423	0,03
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates-A2- 2.811% 15 - 25.01.25	170 256	USD	167 849	166 362	0,02
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates-A2- 2.862% 19 - 25.05.26	244 902	USD	242 574	235 863	0,03
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates-A2- 3.208% 19 - 25.02.26	150 000	USD	147 726	145 963	0,02
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates-A2- 3.224% 17 - 25.03.27	180 000	USD	175 768	173 892	0,03
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates-A2- 3.243% 17 - 25.04.27	150 000	USD	143 593	144 778	0,02
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates-A2- 3.444% 18 - 25.12.27	350 000	USD	358 740	338 320	0,05
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates-A2- 3.771% 19 - 25.12.28	500 000	USD	521 908	487 661	0,07
Freddie Mac Pool 1.50% 20 - 01.11.50	79 849	USD	68 572	62 391	0,01
Freddie Mac Pool 1.50% 21 - 01.11.51	800 288	USD	719 733	623 567	0,09
Freddie Mac Pool 1.50% 22 - 01.02.37	166 004	USD	145 044	144 899	0,02
Freddie Mac Pool 1.50% 22 - 01.04.37	657 991	USD	628 190	573 745	0,08
Freddie Mac Pool 2.00% 21 - 01.02.36	216 951	USD	205 896	195 051	0,03
Freddie Mac Pool 2.00% 21 - 01.03.51	339 214	USD	282 164	278 181	0,04
Freddie Mac Pool 2.00% 21 - 01.08.36	188 933	USD	179 459	169 664	0,03
Freddie Mac Pool 2.00% 21 - 01.10.51	305 994	USD	270 644	250 387	0,04
Freddie Mac Pool 2.00% 21 - 01.10.51	268 751	USD	223 559	219 880	0,03
Freddie Mac Pool 2.00% 21 - 01.01.52	878 433	USD	818 956	718 187	0,11
Freddie Mac Pool 2.00% 22 - 01.01.42	156 849	USD	135 687	134 494	0,02
Freddie Mac Pool 2.00% 22 - 01.02.52	669 925	USD	624 459	547 559	0,08
Freddie Mac Pool 2.00% 22 - 01.03.52	1 003 798	USD	934 489	820 793	0,12
Freddie Mac Pool 2.00% 22 - 01.03.37	254 292	USD	247 551	227 673	0,03
Freddie Mac Pool 2.00% 22 - 01.03.52	624 751	USD	581 985	510 190	0,07
Freddie Mac Pool 2.00% 22 - 01.05.37	260 084	USD	247 085	232 858	0,03
Freddie Mac Pool 2.00% 22 - 01.06.52	209 240	USD	187 053	170 872	0,03
Freddie Mac Pool 2.00% 22 - 01.05.51	376 226	USD	314 579	308 358	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Freddie Mac Pool 2.00% 23 - 01.05.42	140 592	USD	120 286	120 479	0,02
Freddie Mac Pool 2.50% 18 - 01.10.31	31 326	USD	31 259	29 530	0,00
Freddie Mac Pool 2.50% 18 - 01.10.36	400 905	USD	392 599	368 553	0,05
Freddie Mac Pool 2.50% 19 - 01.08.49	511 865	USD	492 976	441 537	0,06
Freddie Mac Pool 2.50% 21 - 01.01.51	624 224	USD	600 436	538 316	0,08
Freddie Mac Pool 2.50% 21 - 01.01.51	769 203	USD	739 773	663 152	0,10
Freddie Mac Pool 2.50% 21 - 01.09.51	423 516	USD	366 450	361 933	0,05
Freddie Mac Pool 2.50% 21 - 01.12.36	78 549	USD	75 578	72 510	0,01
Freddie Mac Pool 2.50% 21 - 01.01.52	175 101	USD	149 752	149 445	0,02
Freddie Mac Pool 2.50% 22 - 01.03.52	896 038	USD	852 821	762 990	0,11
Freddie Mac Pool 2.50% 22 - 01.04.52	691 684	USD	662 489	588 980	0,09
Freddie Mac Pool 2.50% 22 - 01.01.51	197 213	USD	169 592	169 177	0,02
Freddie Mac Pool 2.50% 22 - 01.07.52	327 246	USD	281 752	278 655	0,04
Freddie Mac Pool 2.50% 22 - 01.01.52	404 171	USD	355 260	349 939	0,05
Freddie Mac Pool 2.50% 23 - 01.05.52	295 223	USD	251 379	252 406	0,04
Freddie Mac Pool 2.50% 23 - 01.05.52	199 416	USD	163 024	170 526	0,03
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.11.42	121 012	USD	120 836	110 245	0,02
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.01.43	105 195	USD	105 042	95 835	0,01
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.12.46	75 355	USD	74 903	68 090	0,01
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.01.47	77 449	USD	76 985	69 982	0,01
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.12.47	221 140	USD	219 385	199 641	0,03
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.08.45	128 214	USD	127 428	116 119	0,02
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.09.46	91 031	USD	90 305	82 499	0,01
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.12.46	138 615	USD	137 785	125 264	0,02
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.12.47	114 819	USD	113 908	103 656	0,02
Freddie Mac Pool 3.00% 18 - 01.01.48	168 961	USD	167 619	152 535	0,02
Freddie Mac Pool 3.00% 19 - 01.08.47	169 794	USD	163 275	153 424	0,02
Freddie Mac Pool 3.00% 22 - 01.01.52	275 017	USD	237 610	243 096	0,04
Freddie Mac Pool 3.00% 22 - 01.02.52	144 947	USD	130 110	128 722	0,02
Freddie Mac Pool 3.50% 18 - 01.07.32	90 854	USD	92 496	87 472	0,01
Freddie Mac Pool 3.50% 18 - 01.10.47	101 635	USD	101 098	94 767	0,01
Freddie Mac Pool 3.50% 18 - 01.01.48	211 650	USD	213 801	198 053	0,03
Freddie Mac Pool 3.50% 18 - 01.03.48	353 670	USD	357 626	331 427	0,05
Freddie Mac Pool 3.50% 22 - 01.07.52	187 611	USD	171 956	172 360	0,03
Freddie Mac Pool 4.00% 18 - 01.01.29	15 966	USD	16 314	15 695	0,00
Freddie Mac Pool 4.00% 18 - 01.08.47	154 327	USD	157 244	148 730	0,02
Freddie Mac Pool 4.00% 19 - 01.03.49	55 366	USD	57 093	53 254	0,01
Freddie Mac Pool 4.00% 21 - 01.07.51	711 822	USD	728 622	675 636	0,10
Freddie Mac Pool 4.00% 22 - 01.09.52	206 996	USD	195 682	195 956	0,03
Freddie Mac Pool 4.00% 22 - 01.11.37	67 258	USD	66 083	65 957	0,01
Freddie Mac Pool 4.00% 22 - 01.01.53	162 775	USD	154 033	154 043	0,02
Freddie Mac Pool 4.50% 19 - 01.08.49	171 377	USD	178 491	168 608	0,02
Freddie Mac Pool 4.50% 20 - 01.05.50	22 422	USD	23 331	21 952	0,00
Freddie Mac Pool 4.50% 22 - 01.06.52	112 246	USD	114 192	108 927	0,02
Freddie Mac Pool 4.50% 22 - 01.06.52	164 440	USD	165 318	159 577	0,02
Freddie Mac Pool 4.50% 22 - 01.07.52	274 051	USD	274 542	265 947	0,04
Freddie Mac Pool 5.00% 22 - 01.05.52	87 821	USD	90 787	86 934	0,01
Freddie Mac Pool 5.00% 22 - 01.08.52	135 966	USD	134 293	134 862	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Freddie Mac Pool 5.00% 22 - 01.01.53	198 314	USD	199 161	196 506	0,03
Freddie Mac Pool 5.00% 23 - 01.07.53	241 564	USD	236 372	239 109	0,04
Freddie Mac Pool 5.00% 23 - 01.03.38	198 587	USD	199 577	199 702	0,03
Freddie Mac Pool 5.50% 22 - 01.04.50	223 767	USD	229 437	230 799	0,03
Freddie Mac Pool 5.50% 22 - 01.12.52	186 833	USD	188 096	187 879	0,03
Freddie Mac Pool 5.50% 23 - 01.07.38	88 049	USD	88 510	89 263	0,01
Freddie Mac Pool 6.00% 18 - 01.02.38	69 707	USD	75 986	72 824	0,01
Freddie Mac Pool 6.00% 23 - 01.08.53	192 944	USD	187 944	195 949	0,03
Freddie Mac Pool 6.50% 23 - 01.10.53	196 270	USD	195 195	201 012	0,03
Freddie Mac Pool 6.50% 23 - 01.12.53	298 008	USD	302 827	305 207	0,04
Ginnie Mae I Pool 3.00% 15 - 15.06.45	70 922	USD	71 218	65 185	0,01
Ginnie Mae I Pool 3.00% 15 - 15.07.45	18 064	USD	18 140	16 603	0,00
Ginnie Mae I Pool 3.50% 11 - 15.10.41	21 880	USD	22 510	20 779	0,00
Ginnie Mae I Pool 3.50% 12 - 15.09.42	30 222	USD	31 096	28 702	0,00
Ginnie Mae I Pool 3.50% 13 - 15.06.43	35 691	USD	36 599	33 888	0,01
Ginnie Mae I Pool 4.00% 10 - 15.12.40	28 779	USD	30 316	28 064	0,00
Ginnie Mae I Pool 4.00% 10 - 15.12.40	27 124	USD	28 573	26 450	0,00
Ginnie Mae I Pool 4.00% 11 - 15.01.41	26 348	USD	27 756	25 693	0,00
Ginnie Mae I Pool 4.00% 11 - 15.10.41	14 969	USD	15 777	14 611	0,00
Ginnie Mae I Pool 4.00% 11 - 15.11.41	14 959	USD	15 766	14 601	0,00
Ginnie Mae I Pool 4.50% 09 - 15.07.39	11 557	USD	12 438	11 564	0,00
Ginnie Mae I Pool 4.50% 21 - 15.02.49	27 075	USD	28 952	27 051	0,00
Ginnie Mae II Pool 1.50% 21 - 20.05.51	39 712	USD	36 500	32 350	0,00
Ginnie Mae II Pool 2.00% 20 - 20.12.50	83 443	USD	71 339	68 889	0,01
Ginnie Mae II Pool 2.00% 21 - 20.01.51	160 919	USD	139 936	136 506	0,02
Ginnie Mae II Pool 2.00% 21 - 20.10.51	1 072 702	USD	1 024 447	907 935	0,13
Ginnie Mae II Pool 2.00% 21 - 20.12.51	917 406	USD	876 122	776 208	0,11
Ginnie Mae II Pool 2.00% 22 - 20.01.52	952 157	USD	893 556	805 464	0,12
Ginnie Mae II Pool 2.00% 22 - 20.02.52	154 466	USD	134 749	130 639	0,02
Ginnie Mae II Pool 2.00% 22 - 20.03.52	536 733	USD	450 131	453 942	0,07
Ginnie Mae II Pool 2.00% 22 - 20.08.51	181 700	USD	149 983	149 601	0,02
Ginnie Mae II Pool 2.00% 23 - 20.12.52	153 426	USD	126 872	124 843	0,02
Ginnie Mae II Pool 2.50% 12 - 20.12.42	94 141	USD	92 635	83 943	0,01
Ginnie Mae II Pool 2.50% 13 - 20.01.43	76 828	USD	75 598	68 505	0,01
Ginnie Mae II Pool 2.50% 13 - 20.03.43	97 005	USD	95 447	86 509	0,01
Ginnie Mae II Pool 2.50% 13 - 20.04.43	75 503	USD	74 290	67 334	0,01
Ginnie Mae II Pool 2.50% 13 - 20.06.43	86 859	USD	85 462	77 461	0,01
Ginnie Mae II Pool 2.50% 16 - 20.11.46	46 090	USD	42 022	40 913	0,01
Ginnie Mae II Pool 2.50% 16 - 20.12.46	93 177	USD	88 051	82 711	0,01
Ginnie Mae II Pool 2.50% 20 - 20.07.50	275 769	USD	269 046	242 814	0,04
Ginnie Mae II Pool 2.50% 20 - 20.12.50	169 065	USD	144 952	146 458	0,02
Ginnie Mae II Pool 2.50% 21 - 20.04.51	244 172	USD	231 679	214 275	0,03
Ginnie Mae II Pool 2.50% 21 - 20.05.51	216 293	USD	204 215	189 776	0,03
Ginnie Mae II Pool 2.50% 21 - 20.08.51	239 246	USD	221 443	209 600	0,03
Ginnie Mae II Pool 2.50% 21 - 20.09.51	487 456	USD	443 775	426 825	0,06
Ginnie Mae II Pool 2.50% 21 - 20.10.51	282 132	USD	265 781	246 955	0,04
Ginnie Mae II Pool 2.50% 21 - 20.11.51	418 962	USD	394 615	366 782	0,05
Ginnie Mae II Pool 2.50% 21 - 20.12.51	382 664	USD	360 309	335 395	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Ginnie Mae II Pool 2.50% 22 - 20.02.52	336 789	USD	295 707	294 817	0,04
Ginnie Mae II Pool 2.50% 22 - 20.04.52	221 517	USD	196 881	193 886	0,03
Ginnie Mae II Pool 2.50% 22 - 20.06.52	221 659	USD	208 625	194 219	0,03
Ginnie Mae II Pool 2.50% 22 - 20.03.52	308 354	USD	272 385	267 357	0,04
Ginnie Mae II Pool 2.50% 22 - 20.12.37	41 883	USD	38 281	38 432	0,01
Ginnie Mae II Pool 3.00% 15 - 20.06.45	274 606	USD	274 892	252 588	0,04
Ginnie Mae II Pool 3.00% 15 - 20.12.45	64 893	USD	64 960	59 689	0,01
Ginnie Mae II Pool 3.00% 16 - 20.12.45	80 071	USD	80 155	73 651	0,01
Ginnie Mae II Pool 3.00% 16 - 20.05.46	117 921	USD	113 333	108 430	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.00% 17 - 20.10.47	220 358	USD	219 828	202 371	0,03
Ginnie Mae II Pool 3.00% 17 - 20.12.47	139 642	USD	135 443	128 244	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.00% 18 - 20.04.48	356 374	USD	355 516	327 286	0,05
Ginnie Mae II Pool 3.00% 21 - 20.07.51	464 708	USD	446 477	421 868	0,06
Ginnie Mae II Pool 3.00% 21 - 20.08.51	369 334	USD	354 679	335 172	0,05
Ginnie Mae II Pool 3.00% 21 - 20.09.51	190 114	USD	180 590	172 471	0,03
Ginnie Mae II Pool 3.00% 21 - 20.12.51	91 976	USD	87 066	83 354	0,01
Ginnie Mae II Pool 3.00% 22 - 20.04.52	308 055	USD	282 996	278 731	0,04
Ginnie Mae II Pool 3.00% 22 - 20.05.52	180 485	USD	163 201	163 305	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.00% 22 - 20.07.52	179 349	USD	161 986	162 540	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.00% 22 - 20.08.52	143 153	USD	130 964	129 825	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 15 - 20.03.45	95 629	USD	97 495	90 376	0,01
Ginnie Mae II Pool 3.50% 15 - 20.05.45	101 564	USD	103 547	95 985	0,01
Ginnie Mae II Pool 3.50% 15 - 20.08.45	155 288	USD	158 323	146 758	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 15 - 20.10.45	118 608	USD	120 927	112 093	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 15 - 20.11.45	126 379	USD	128 851	119 437	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 15 - 20.12.45	132 666	USD	135 261	125 378	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 16 - 20.01.46	125 548	USD	128 005	118 652	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 17 - 20.09.47	150 911	USD	152 918	142 322	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 17 - 20.12.47	159 125	USD	161 243	150 069	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 18 - 20.03.48	154 580	USD	156 639	145 782	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 18 - 20.04.48	139 616	USD	134 587	131 555	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 18 - 20.02.48	167 906	USD	156 280	158 350	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 18 - 20.10.48	139 206	USD	140 930	131 168	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 19 - 20.03.49	82 391	USD	83 413	77 634	0,01
Ginnie Mae II Pool 3.50% 22 - 20.06.52	186 894	USD	174 812	173 881	0,03
Ginnie Mae II Pool 3.50% 22 - 20.09.52	187 304	USD	174 094	174 263	0,03
Ginnie Mae II Pool 3.50% 23 - 20.03.52	143 676	USD	132 625	133 009	0,02
Ginnie Mae II Pool 3.50% 23 - 20.11.52	139 247	USD	128 586	127 339	0,02
Ginnie Mae II Pool 4.00% 09 - 20.03.39	19 356	USD	20 469	18 954	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.00% 10 - 20.11.40	30 970	USD	32 486	30 251	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.00% 11 - 20.01.41	32 055	USD	33 625	31 310	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.00% 11 - 20.07.41	54 188	USD	56 850	52 925	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.00% 12 - 20.04.42	33 036	USD	34 693	32 256	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.00% 12 - 20.05.42	62 421	USD	65 552	60 947	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.00% 12 - 20.06.42	123 858	USD	130 074	120 933	0,02
Ginnie Mae II Pool 4.00% 12 - 20.12.42	59 365	USD	62 352	57 963	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.00% 14 - 20.02.44	27 115	USD	28 479	26 451	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.00% 17 - 20.06.47	61 170	USD	63 175	59 121	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Ginnie Mae II Pool 4.00% 17 - 20.11.47	57 273	USD	59 196	55 355	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.00% 17 - 20.12.47	25 486	USD	26 323	24 633	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.00% 18 - 20.02.48	63 093	USD	65 165	60 980	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.00% 18 - 20.03.48	57 040	USD	58 914	55 130	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.00% 22 - 20.06.52	91 813	USD	85 198	87 582	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.00% 22 - 20.07.52	171 847	USD	172 640	164 066	0,02
Ginnie Mae II Pool 4.00% 22 - 20.09.52	188 263	USD	178 427	179 587	0,03
Ginnie Mae II Pool 4.00% 22 - 20.11.52	276 214	USD	267 094	263 485	0,04
Ginnie Mae II Pool 4.50% 10 - 20.01.40	23 072	USD	24 685	23 095	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.50% 10 - 20.08.40	26 849	USD	28 772	26 868	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.50% 10 - 20.10.40	27 738	USD	29 726	27 758	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.50% 11 - 20.01.41	30 530	USD	32 722	30 552	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.50% 11 - 20.04.41	30 729	USD	32 954	30 705	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.50% 11 - 20.06.41	24 757	USD	26 552	24 738	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.50% 13 - 20.09.43	32 422	USD	34 563	32 277	0,00
Ginnie Mae II Pool 4.50% 14 - 20.10.44	39 615	USD	42 157	39 377	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.50% 22 - 20.07.52	276 904	USD	279 486	270 377	0,04
Ginnie Mae II Pool 4.50% 22 - 20.08.52	242 125	USD	237 521	236 762	0,03
Ginnie Mae II Pool 4.50% 22 - 20.09.52	240 643	USD	230 595	234 970	0,03
Ginnie Mae II Pool 4.50% 22 - 20.11.52	95 192	USD	92 511	92 948	0,01
Ginnie Mae II Pool 4.50% 23 - 20.04.53	195 823	USD	186 940	191 033	0,03
Ginnie Mae II Pool 5.00% 19 - 20.09.49	30 815	USD	32 489	31 077	0,00
Ginnie Mae II Pool 5.00% 21 - 20.08.51	41 403	USD	43 774	41 736	0,01
Ginnie Mae II Pool 5.00% 22 - 20.08.52	229 810	USD	234 617	228 345	0,03
Ginnie Mae II Pool 5.00% 22 - 20.08.52	116 768	USD	117 292	116 093	0,02
Ginnie Mae II Pool 5.00% 22 - 20.10.52	140 264	USD	139 480	139 370	0,02
Ginnie Mae II Pool 5.00% 22 - 20.11.52	94 536	USD	93 753	93 933	0,01
Ginnie Mae II Pool 5.00% 23 - 20.03.50	138 205	USD	137 441	139 315	0,02
Ginnie Mae II Pool 5.00% 23 - 20.10.52	125 376	USD	126 197	124 652	0,02
Ginnie Mae II Pool 5.00% 23 - 20.02.53	139 599	USD	138 959	138 709	0,02
Ginnie Mae II Pool 5.00% 23 - 20.11.53	199 661	USD	195 536	198 274	0,03
Ginnie Mae II Pool 5.50% 22 - 20.09.52	89 370	USD	89 598	89 884	0,01
Ginnie Mae II Pool 5.50% 22 - 20.10.52	96 815	USD	99 169	97 518	0,01
Ginnie Mae II Pool 5.50% 22 - 20.10.52	126 806	USD	127 146	127 534	0,02
Ginnie Mae II Pool 5.50% 22 - 20.12.52	183 672	USD	185 864	184 727	0,03
Ginnie Mae II Pool 5.50% 23 - 20.06.53	236 421	USD	234 606	237 787	0,04
Ginnie Mae II Pool 5.50% 23 - 20.10.53	199 303	USD	190 732	200 456	0,03
Ginnie Mae II Pool 6.00% 22 - 20.12.52	178 780	USD	182 006	181 926	0,03
Ginnie Mae II Pool 6.00% 23 - 20.01.53	197 119	USD	200 461	200 229	0,03
Ginnie Mae II Pool 6.00% 23 - 20.07.53	98 755	USD	99 148	100 322	0,01
Ginnie Mae II Pool 6.00% 23 - 20.10.53	199 108	USD	195 295	202 269	0,03
Ginnie Mae II Pool 6.00% 23 - 20.12.53	200 000	USD	203 438	203 175	0,03
Ginnie Mae II Pool 6.50% 23 - 20.07.53	197 192	USD	200 930	201 832	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé^(A)					
Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires (suite)					
États-Unis (suite)					
Ginnie Mae II Pool 6.50% 23 - 20.11.53	249 540	USD	253 770	255 412	0,04
Ginnie Mae II Pool 7.00% 23 - 20.11.53	99 834	USD	102 245	102 521	0,02
			86 164 223	81 441 911	11,90
Total - Obligations adossées à des actifs et à des créances hypothécaires			86 164 223	81 441 911	11,90
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé			103 066 739	98 120 373	14,34
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			715 442 628	678 183 287	99,10
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				682 912 816	99,79

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
ams-OSRAM AG 10.50% 23 - 30.03.29	2 900 000	EUR	2 955 324	3 135 350	0,23
Benteler International AG 144A 9.375% 23 - 15.05.28	2 400 000	EUR	2 449 071	2 555 634	0,19
Sappi Papier Holdings GmbH 3.625% 21 - 15.03.28	1 800 000	EUR	1 688 337	1 723 191	0,13
			7 092 732	7 414 175	0,55
Belgique					
Azelis Finance NV 5.75% 23 - 15.03.28	1 900 000	EUR	1 933 952	1 963 393	0,15
Manuchar Group Sarl 7.25% 22 - 30.06.27	1 600 000	EUR	1 469 140	1 487 333	0,11
Ontex Group NV 3.50% 21 - 15.07.26	2 700 000	EUR	2 539 321	2 592 911	0,19
			5 942 413	6 043 637	0,45
Îles Vierges britanniques					
Fortune Star BVI Ltd. 3.95% 21 - 02.10.26	2 250 000	EUR	1 748 684	1 457 408	0,11
			1 748 684	1 457 408	0,11
Bulgarie					
Bulgarian Energy Holdings EAD 2.45% 21 - 22.07.28	2 800 000	EUR	2 491 438	2 413 634	0,18
Bulgarian Energy Holdings EAD 3.50% 18 - 28.06.25	2 650 000	EUR	2 576 221	2 563 595	0,19
			5 067 659	4 977 229	0,37
République tchèque					
Allwyn International AS 3.875% 20 - 15.02.27	2 200 000	EUR	2 084 035	2 113 100	0,16
EP Infrastructure AS 1.698% 19 - 30.07.26	2 700 000	EUR	2 358 788	2 424 937	0,18
EP Infrastructure AS 1.816% 21 - 02.03.31	2 350 000	EUR	1 714 760	1 815 046	0,13
EP Infrastructure AS 2.045% 19 - 09.10.28	2 250 000	EUR	1 795 082	1 866 722	0,14
			7 952 665	8 219 805	0,61
Danemark					
Skill Bidco ApS FRN 23 - 02.03.28	2 750 000	EUR	2 682 960	2 763 887	0,20
Skill Bidco ApS FRN 23 - 02.03.28	650 000	EUR	648 867	653 283	0,05
			3 331 827	3 417 170	0,25
Finlande					
Ahlstrom-Munksjo Holdings 3 Oy 3.625% 21 - 04.02.28	1 600 000	EUR	1 413 082	1 440 333	0,11
Huhtamaki OYJ 4.25% 22 - 09.06.27	2 300 000	EUR	2 257 527	2 302 153	0,17
Huhtamaki OYJ 5.125% 23 - 24.11.28	1 400 000	EUR	1 434 814	1 456 706	0,11
PHM Group Holding Oy 144A FRN 22 - 19.06.26	1 200 000	EUR	1 215 758	1 210 650	0,09
PHM Group Holdings Oy 144A 4.75% 21 - 18.06.26	1 520 000	EUR	1 429 592	1 377 183	0,10
SBB Treasury OYJ 0.75% 20 - 14.12.28	3 200 000	EUR	2 046 220	1 886 480	0,14
SBB Treasury OYJ 1.125% 21 - 26.11.29	4 300 000	EUR	2 732 347	2 520 816	0,19
			12 529 340	12 194 321	0,91
France					
Afflelou SAS 4.25% 21 - 19.05.26	2 100 000	EUR	2 028 715	2 082 547	0,16
Air France-KLM 8.125% 23 - 31.05.28	2 300 000	EUR	2 637 203	2 606 225	0,19
Altice France SA 2.125% 20 - 15.02.25	2 250 000	EUR	2 155 269	2 161 607	0,16
Altice France SA 2.50% 19 - 15.01.25	2 450 000	EUR	2 347 647	2 357 512	0,18
Altice France SA 3.375% 19 - 15.01.28	4 600 000	EUR	3 817 339	3 628 412	0,27
Altice France SA 4.00% 21 - 15.07.29	1 800 000	EUR	1 447 474	1 388 250	0,10
Altice France SA 4.125% 20 - 15.01.29	2 300 000	EUR	1 897 741	1 823 900	0,14
Altice France SA 4.25% 21 - 15.10.29	3 600 000	EUR	2 949 641	2 845 761	0,21
Altice France SA 5.875% 18 - 01.02.27	4 500 000	EUR	4 100 606	3 990 025	0,30
Atos SE 1.00% 21 - 12.11.29	3 600 000	EUR	2 347 923	1 923 804	0,14
Atos SE 1.75% 18 - 07.05.25	3 400 000	EUR	2 866 529	2 571 454	0,19

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Atos SE 2.50% 18 - 07.11.28	1 600 000	EUR	1 133 374	959 568	0,07
Banijay Entertainment SASU 7.00% 23 - 01.05.29	2 400 000	EUR	2 398 094	2 527 178	0,19
Banijay Group SAS 6.50% 20 - 01.03.26	1 800 000	EUR	1 781 006	1 793 996	0,13
Burger King France SAS FRN 21 - 01.11.26	2 850 000	EUR	2 844 676	2 858 016	0,21
CAB SELAS 3.375% 21 - 01.02.28	5 200 000	EUR	4 686 514	4 619 087	0,34
Cerba Healthcare SACA 3.50% 21 - 31.05.28	3 300 000	EUR	2 920 214	2 744 197	0,20
CGG SA 7.75% 21 - 01.04.27	2 700 000	EUR	2 516 203	2 474 719	0,18
Chrome Holdco SASU 5.00% 21 - 31.05.29	2 350 000	EUR	1 975 952	1 624 907	0,12
Constellium SE 3.125% 21 - 15.07.29	1 360 000	EUR	1 204 521	1 246 837	0,09
Constellium SE 4.25% 17 - 15.02.26	1 880 000	EUR	1 851 177	1 867 955	0,14
Crown European Holdings SA 2.625% 16 - 30.09.24	2 700 000	EUR	2 682 629	2 661 701	0,20
Crown European Holdings SA 2.875% 18 - 01.02.26	2 300 000	EUR	2 251 821	2 254 920	0,17
Crown European Holdings SA 3.375% 15 - 15.05.25	2 700 000	EUR	2 686 791	2 674 851	0,20
Crown European Holdings SA 4.75% 23 - 15.03.29	2 300 000	EUR	2 364 101	2 340 342	0,17
Crown European Holdings SA 5.00% 23 - 15.05.28	2 300 000	EUR	2 313 378	2 381 967	0,18
Derichebourg SA 2.25% 21 - 15.07.28	1 400 000	EUR	1 266 416	1 308 070	0,10
Elior Group SA 3.75% 21 - 15.07.26	2 500 000	EUR	2 239 843	2 305 292	0,17
Elis SA 1.625% 19 - 03.04.28	2 600 000	EUR	2 399 292	2 387 118	0,18
Elis SA 2.875% 18 - 15.02.26	1 500 000	EUR	1 467 268	1 473 433	0,11
Elis SA 4.125% 22 - 24.05.27	1 200 000	EUR	1 193 372	1 212 253	0,09
Emeria SASU 3.375% 21 - 31.03.28	1 800 000	EUR	1 584 292	1 539 338	0,11
Emeria SASU 7.75% 23 - 31.03.28	1 850 000	EUR	1 781 958	1 788 345	0,13
Eramet SA 7.00% 23 - 22.05.28	2 200 000	EUR	2 218 034	2 236 520	0,17
Eutelsat SA 1.50% 20 - 13.10.28	2 700 000	EUR	1 946 383	2 017 723	0,15
Eutelsat SA 2.25% 19 - 13.07.27	2 700 000	EUR	2 222 386	2 319 171	0,17
Fnac Darty SA 1.875% 19 - 30.05.24	1 300 000	EUR	1 291 122	1 280 249	0,10
Fnac Darty SA 2.625% 19 - 30.05.26	1 700 000	EUR	1 653 073	1 619 989	0,12
Forvia 2.375% 19 - 15.06.27	4 000 000	EUR	3 681 060	3 768 143	0,28
Forvia 2.375% 21 - 15.06.29	1 200 000	EUR	1 069 015	1 091 779	0,08
Forvia 2.375% 21 - 15.06.29	300 000	EUR	248 856	272 945	0,02
Forvia 2.625% 18 - 15.06.25	4 490 000	EUR	4 394 889	4 393 941	0,33
Forvia 2.75% 21 - 15.02.27	5 400 000	EUR	5 078 468	5 153 849	0,38
Forvia 3.125% 19 - 15.06.26	3 400 000	EUR	3 278 726	3 324 939	0,25
Forvia 3.75% 20 - 15.06.28	3 200 000	EUR	3 013 818	3 123 617	0,23
Forvia 7.25% 22 - 15.06.26	3 800 000	EUR	3 910 302	4 020 563	0,30
Forvia SE 2.375% 21 - 15.06.29	300 000	EUR	259 829	272 945	0,02
Getlink SE 3.50% 20 - 30.10.25	3 940 000	EUR	3 899 773	3 894 239	0,29
Goldstory SASU 5.375% 21 - 01.03.26	1 700 000	EUR	1 668 741	1 686 995	0,13
Goldstory SASU FRN 21 - 01.03.26	950 000	EUR	945 548	959 698	0,07
Iliad Holdings SASU 5.125% 21 - 15.10.26	4 960 000	EUR	4 867 027	4 930 692	0,37
Iliad Holdings SASU 5.625% 21 - 15.10.28	3 400 000	EUR	3 301 864	3 409 204	0,25
iliad SA 1.50% 17 - 14.10.24	2 000 000	EUR	1 965 164	1 952 769	0,15
iliad SA 1.875% 18 - 25.04.25	2 900 000	EUR	2 811 796	2 808 844	0,21
iliad SA 1.875% 21 - 11.02.28	3 200 000	EUR	2 825 622	2 930 788	0,22
iliad SA 2.375% 20 - 17.06.26	3 000 000	EUR	2 846 456	2 863 200	0,21
iliad SA 5.375% 22 - 14.06.27	3 400 000	EUR	3 397 161	3 486 388	0,26
iliad SA 5.625% 23 - 15.02.30	2 300 000	EUR	2 262 193	2 376 038	0,18
Iliad SA 5.375% 23 - 15.02.29	3 000 000	EUR	3 073 152	3 073 547	0,23

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
IM Group SAS 8.00% 23 - 01.03.28	1 200 000	EUR	1 103 672	938 269	0,07
Iqera Group SAS FRN 23 - 15.02.27	2 300 000	EUR	2 114 665	1 994 606	0,15
Kapla Holdings SAS 3.375% 19 - 15.12.26	1 900 000	EUR	1 796 691	1 833 869	0,14
Kapla Holdings SAS FRN 19 - 15.12.26	1 960 000	EUR	1 918 161	1 955 035	0,15
La Financiere Atalian SASU 4.00% 17 - 15.05.24	2 800 000	EUR	2 566 200	2 210 250	0,16
La Financiere Atalian SASU 5.125% 18 - 15.05.25	1 660 000	EUR	1 403 224	1 213 183	0,09
Laboratoire Eimer Selas 5.00% 21 - 01.02.29	1 100 000	EUR	941 520	886 646	0,07
Loxam SAS 2.875% 19 - 15.04.26	1 300 000	EUR	1 226 453	1 257 119	0,09
Loxam SAS 3.75% 19 - 15.07.26	2 000 000	EUR	1 933 618	1 973 850	0,15
Loxam SAS 4.50% 22 - 15.02.27	1 600 000	EUR	1 537 275	1 594 343	0,12
Loxam SAS 6.375% 23 - 15.05.28	1 900 000	EUR	1 888 816	1 973 649	0,15
Loxam SAS 6.375% 23 - 31.05.29	2 700 000	EUR	2 829 654	2 792 108	0,21
Mobilux Finance SAS 4.25% 21 - 15.07.28	2 200 000	EUR	1 954 908	1 986 979	0,15
Nexans SA 5.50% 23 - 05.04.28	1 800 000	EUR	1 842 465	1 906 088	0,14
Novafives SAS 5.00% 18 - 15.06.25	1 400 000	EUR	1 324 626	1 373 400	0,10
Novafives SAS FRN 18 - 15.06.25	1 250 000	EUR	1 178 021	1 231 916	0,09
Paprec Holding SA 6.50% 23 - 17.11.27	1 400 000	EUR	1 443 950	1 494 764	0,11
Paprec Holding SA 7.25% 23 - 17.11.29	1 300 000	EUR	1 338 390	1 394 088	0,10
Paprec Holdings SA 3.50% 21 - 01.07.28	2 100 000	EUR	1 957 711	2 017 648	0,15
Parts Europe SA 6.50% 20 - 16.07.25	2 550 000	EUR	2 561 586	2 547 104	0,19
Parts Europe SA FRN 21 - 20.07.27	1 750 000	EUR	1 746 728	1 757 527	0,13
Picard Groupe SAS 3.875% 21 - 01.07.26	3 400 000	EUR	3 246 538	3 306 993	0,25
Renault SA 1.00% 17 - 28.11.25	3 400 000	EUR	3 270 375	3 231 105	0,24
Renault SA 1.00% 18 - 18.04.24	3 100 000	EUR	3 076 076	3 059 665	0,23
Renault SA 1.125% 19 - 04.10.27	2 200 000	EUR	1 954 050	2 007 197	0,15
Renault SA 1.25% 19 - 24.06.25	4 500 000	EUR	4 332 510	4 314 902	0,32
Renault SA 2.00% 18 - 28.09.26	3 400 000	EUR	3 187 328	3 239 090	0,24
Renault SA 2.375% 20 - 25.05.26	4 500 000	EUR	4 308 599	4 348 886	0,32
Renault SA 2.50% 21 - 01.04.28	2 800 000	EUR	2 609 649	2 679 151	0,20
Renault SA 2.50% 21 - 02.06.27	2 300 000	EUR	2 152 052	2 200 422	0,16
Rexel SA 2.125% 21 - 15.06.28	1 800 000	EUR	1 673 736	1 691 485	0,13
Rexel SA 2.125% 21 - 15.12.28	2 750 000	EUR	2 525 166	2 556 944	0,19
Rexel SA 5.25% 23 - 15.09.30	1 900 000	EUR	1 897 056	1 978 795	0,15
Seche Environnement SA 2.25% 21 - 15.11.28	1 200 000	EUR	1 075 855	1 075 547	0,08
SNF Group SACA 2.00% 20 - 01.02.26	1 500 000	EUR	1 441 945	1 445 100	0,11
SNF Group SACA 2.625% 20 - 01.02.29	1 700 000	EUR	1 566 227	1 558 736	0,12
SPIE SA 2.625% 19 - 18.06.26	2 800 000	EUR	2 719 296	2 725 916	0,20
Tereos Finance Groupe I SA 4.75% 22 - 30.04.27	1 400 000	EUR	1 351 721	1 406 780	0,10
Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 23 - 15.04.28	1 700 000	EUR	1 728 947	1 796 965	0,13
Tereos Finance Groupe I SA 7.50% 20 - 30.10.25	1 870 000	EUR	1 898 214	1 904 174	0,14
Valeo 1.00% 21 - 03.08.28	3 200 000	EUR	2 803 962	2 796 242	0,21
Valeo 1.50% 18 - 18.06.25	2 700 000	EUR	2 620 674	2 604 196	0,19
Valeo 1.625% 16 - 18.03.26	2 700 000	EUR	2 589 160	2 585 978	0,19
Valeo 3.25% 14 - 22.01.24	3 100 000	EUR	3 099 370	3 095 435	0,23
Valeo 5.375% 22 - 28.05.27	3 300 000	EUR	3 304 979	3 423 761	0,25
Valeo SE 5.875% 23 - 12.04.29	2 800 000	EUR	2 842 121	3 001 859	0,22
			244 153 377	244 060 127	18,15

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Adler Pelzer Holdings GmbH 9.50% 23 - 01.04.27	1 800 000	EUR	1 684 054	1 788 926	0,13
ADLER Real Estate AG 3.00% 18 - 27.04.26	1 400 000	EUR	1 130 491	1 054 083	0,08
APCOA Parking Holdings GmbH 4.625% 21 - 15.01.27	1 500 000	EUR	1 381 179	1 405 220	0,10
APCOA Parking Holdings GmbH FRN 21 - 15.01.27	1 600 000	EUR	1 579 418	1 597 000	0,12
Bilfinger SE 4.50% 19 - 14.06.24	1 000 000	EUR	1 000 465	993 333	0,07
BRANICKS Group AG 2.25% 21 - 22.09.26	1 800 000	EUR	1 210 955	571 680	0,04
CECONOMY AG 1.75% 21 - 24.06.26	2 200 000	EUR	1 889 378	1 903 985	0,14
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 20 - 11.02.27	2 400 000	EUR	2 275 420	2 319 705	0,17
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.375% 20 - 15.01.28	2 700 000	EUR	2 572 338	2 628 062	0,20
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 7.50% 23 - 15.05.30	3 300 000	EUR	3 321 213	3 509 866	0,26
Cheplapharm Arzneimittel GmbH FRN 23 - 15.05.30	1 300 000	EUR	1 307 229	1 330 193	0,10
Commerzbank AG 4.00% 16 - 23.03.26	4 500 000	EUR	4 501 693	4 507 590	0,34
Commerzbank AG 4.00% 17 - 30.03.27	3 000 000	EUR	3 017 113	3 043 059	0,23
CT Investment GmbH 5.50% 21 - 15.04.26	2 100 000	EUR	1 998 297	2 080 208	0,16
Ctec II GmbH 5.25% 22 - 15.02.30	2 100 000	EUR	1 842 988	1 860 469	0,14
DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.875% 19 - 15.10.24	2 500 000	EUR	2 155 019	1 512 342	0,11
Douglas GmbH 6.00% 21 - 08.04.26	5 900 000	EUR	5 620 771	5 831 166	0,43
Gruenthal GmbH 3.625% 21 - 15.11.26	1 810 000	EUR	1 754 896	1 782 204	0,13
Gruenthal GmbH 4.125% 21 - 15.05.28	2 500 000	EUR	2 391 559	2 468 298	0,18
Gruenthal GmbH 6.75% 23 - 15.05.30	1 350 000	EUR	1 368 609	1 428 817	0,11
Hapag-Lloyd AG 2.50% 21 - 15.04.28	1 350 000	EUR	1 247 944	1 256 387	0,09
Hornbach Baumarkt AG 3.25% 19 - 25.10.26	1 100 000	EUR	1 075 017	1 046 333	0,08
HT Troplast GmbH 9.375% 23 - 15.07.28	1 700 000	EUR	1 697 987	1 723 579	0,13
INEOS Styrolution Group GmbH 2.25% 20 - 16.01.27	2 710 000	EUR	2 471 086	2 488 095	0,19
Mahle GmbH 2.375% 21 - 14.05.28	3 400 000	EUR	2 881 032	2 896 883	0,22
Nidda Healthcare Holdings GmbH 7.50% 22 - 21.08.26	6 300 000	EUR	6 242 667	6 471 217	0,48
Novelis Sheet Ingot GmbH 3.375% 21 - 15.04.29	2 200 000	EUR	2 035 050	2 070 791	0,15
PCF GmbH 4.75% 21 - 15.04.26	1 800 000	EUR	1 594 001	1 308 000	0,10
PCF GmbH FRN 21 - 15.04.26	1 600 000	EUR	1 440 189	1 228 573	0,09
Peach Property Finance GmbH 4.375% 20 - 15.11.25	1 400 000	EUR	1 208 465	1 100 551	0,08
PrestigeBidCo GmbH FRN 22 - 15.07.27	1 700 000	EUR	1 659 871	1 722 993	0,13
ProGroup AG 3.00% 18 - 31.03.26	2 800 000	EUR	2 686 179	2 714 788	0,20
Renk AG 5.75% 20 - 15.07.25	2 300 000	EUR	2 272 799	2 281 635	0,17
Schaeffler AG 1.875% 19 - 26.03.24	3 600 000	EUR	3 591 543	3 562 666	0,27
Schaeffler AG 2.75% 20 - 12.10.25	3 400 000	EUR	3 352 993	3 330 114	0,25
Schaeffler AG 2.875% 19 - 26.03.27	3 000 000	EUR	2 906 688	2 948 758	0,22
Schaeffler AG 3.375% 20 - 12.10.28	3 400 000	EUR	3 238 035	3 285 811	0,24
Standard Profil Automotive GmbH 6.25% 21 - 30.04.26	1 200 000	EUR	979 365	933 312	0,07
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 18 - 30.07.26	1 670 477	EUR	1 647 161	1 665 187	0,12

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2.00% 20 - 15.07.25	5 110 000	EUR	4 966 373	4 991 375	0,37
thyssenkrupp AG 2.50% 15 - 25.02.25	2 750 000	EUR	2 712 171	2 699 019	0,20
thyssenkrupp AG 2.875% 19 - 22.02.24	6 800 000	EUR	6 786 306	6 757 670	0,50
TK Elevator Holdco GmbH 6.625% 20 - 15.07.28	2 610 000	EUR	2 375 739	2 402 952	0,18
TK Elevator Midco GmbH 4.375% 20 - 15.07.27	5 000 000	EUR	4 760 248	4 815 312	0,36
TK Elevator Midco GmbH FRN 20 - 15.07.27	2 300 000	EUR	2 290 660	2 323 891	0,17
TUI Cruises GmbH 6.50% 21 - 15.05.26	2 400 000	EUR	2 304 252	2 364 144	0,18
WEPA Hygieneprodukte GmbH 2.875% 19 - 15.12.27	1 900 000	EUR	1 723 706	1 773 627	0,13
ZF Finance GmbH 2.00% 21 - 06.05.27	2 200 000	EUR	2 011 509	2 029 549	0,15
ZF Finance GmbH 2.25% 21 - 03.05.28	2 300 000	EUR	2 069 669	2 106 206	0,16
ZF Finance GmbH 2.75% 20 - 25.05.27	2 300 000	EUR	2 135 578	2 181 974	0,16
ZF Finance GmbH 3.00% 20 - 21.09.25	3 300 000	EUR	3 217 936	3 220 077	0,24
ZF Finance GmbH 3.75% 20 - 21.09.28	3 400 000	EUR	3 218 648	3 274 314	0,24
ZF Finance GmbH 5.75% 23 - 03.08.26	3 000 000	EUR	3 024 161	3 091 485	0,23
			131 828 113	131 683 474	9,79
Gibraltar					
888 Acquisitions Ltd. 7.558% 22 - 15.07.27	2 650 000	EUR	2 442 355	2 525 229	0,19
888 Acquisitions Ltd. FRN 22 - 15.07.28	2 050 000	EUR	1 894 874	1 980 813	0,14
			4 337 229	4 506 042	0,33
Grèce					
Mytilineos SA 2.25% 21 - 30.10.26	2 200 000	EUR	2 101 474	2 092 750	0,16
Public Power Corp. SA 3.375% 21 - 31.07.28	2 200 000	EUR	2 047 051	2 062 091	0,15
Public Power Corp. SA 4.375% 21 - 30.03.26	3 600 000	EUR	3 533 843	3 580 722	0,27
			7 682 368	7 735 563	0,58
Guernesey					
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2.95% 20 - 29.07.26	1 800 000	EUR	1 437 550	1 473 599	0,11
			1 437 550	1 473 599	0,11
Irlande					
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc. 2.125% 19 - 15.08.26	2 000 000	EUR	1 822 040	1 776 300	0,13
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc. 2.125% 20 - 15.08.26	3 600 000	EUR	3 323 580	3 204 000	0,24
eircom Finance Dac 2.625% 19 - 15.02.27	1 590 000	EUR	1 470 438	1 494 103	0,11
eircom Finance Dac 3.50% 19 - 15.05.26	2 500 000	EUR	2 413 345	2 427 587	0,18
Energia Group Roi Financeco DAC 6.875% 23 - 31.07.28	2 700 000	EUR	2 709 241	2 787 750	0,21
James Hardie International Finance DAC 3.625% 18 - 01.10.26	1 710 000	EUR	1 658 731	1 681 113	0,12
Motion Bondco Dac 4.50% 19 - 15.11.27	1 650 000	EUR	1 483 117	1 482 938	0,11
			14 880 492	14 853 791	1,10
Île de Man					
Playtech PLC 4.25% 19 - 07.03.26	1 500 000	EUR	1 467 877	1 465 313	0,11
Playtech PLC 5.875% 23 - 28.06.28	1 400 000	EUR	1 390 261	1 392 518	0,10
			2 858 138	2 857 831	0,21

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Almaviva-The Italian Innovation Co. SpA 4.875% 21 - 30.10.26	1 550 000	EUR	1 504 189	1 526 750	0,11
Amplifon SpA 1.125% 20 - 13.02.27	1 600 000	EUR	1 480 850	1 471 652	0,11
Azzurra Aeroporti SpA 2.125% 20 - 30.05.24	1 500 000	EUR	1 487 621	1 482 492	0,11
Azzurra Aeroporti SpA 2.625% 20 - 30.05.27	1 400 000	EUR	1 310 745	1 302 882	0,10
Bach Bidco SpA FRN 21 - 15.10.28	1 600 000	EUR	1 567 434	1 592 880	0,12
Banca IFIS SpA 1.75% 20 - 25.06.24	1 680 000	EUR	1 662 800	1 649 143	0,12
Banca IFIS SpA 6.125% 23 - 19.01.27	1 300 000	EUR	1 302 800	1 327 960	0,10
Banca IFIS SpA 6.875% 23 - 13.09.28	1 400 000	EUR	1 400 397	1 463 503	0,11
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.875% 20 - 09.01.26	3 400 000	EUR	3 183 319	3 225 213	0,24
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.625% 20 - 28.04.25	3 300 000	EUR	3 173 319	3 214 688	0,24
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.625% 19 - 24.09.24	3 370 000	EUR	3 337 134	3 340 422	0,25
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 10.50% 19 - 23.07.29	1 350 000	EUR	1 353 650	1 474 013	0,11
Banca Popolare di Sondrio SPA 2.375% 19 - 03.04.24	2 150 000	EUR	2 142 745	2 136 455	0,16
Banco BPM SpA 6.00% 22 - 13.09.26	2 250 000	EUR	2 294 817	2 369 492	0,18
Bormioli Pharma Spa FRN 23 - 15.05.28	1 600 000	EUR	1 562 774	1 589 343	0,12
BPER Banca 1.875% 20 - 07.07.25	2 200 000	EUR	2 137 771	2 137 379	0,16
Cedacri Mergerco SPA FRN 21 - 15.05.28	3 400 000	EUR	4 542 250	3 290 197	0,24
Cedacri Mergerco SPA FRN 23 - 15.05.28	1 300 000	EUR	1 266 565	1 282 125	0,10
Cerved Group SpA 6.00% 22 - 15.02.29	1 600 000	EUR	1 441 635	1 450 956	0,11
Cerved Group SpA FRN 22 - 15.02.29	5 650 000	EUR	5 464 383	5 459 980	0,41
Conceria Pasubio SpA FRN 21 - 30.09.28	1 500 000	EUR	1 398 927	1 448 125	0,11
doValue SpA 3.375% 21 - 31.07.26	1 400 000	EUR	1 290 666	1 258 396	0,09
doValue SpA 5.00% 20 - 04.08.25	1 100 000	EUR	1 071 412	1 071 732	0,08
Engineering - Ingegneria Informatica - SpA 5.875% 20 - 30.09.26	2 800 000	EUR	2 660 086	2 736 941	0,20
Engineering - Ingegneria Informatica - SpA 11.125% 23 - 15.05.28	1 700 000	EUR	1 723 003	1 813 779	0,14
Eolo SpA 4.875% 21 - 21.10.28	1 750 000	EUR	1 446 849	1 338 750	0,10
Esselunga SpA 1.875% 17 - 25.10.27	2 150 000	EUR	2 038 967	2 011 681	0,15
EVOCA SpA FRN 19 - 01.11.26	2 500 000	EUR	2 380 263	2 466 522	0,18
Fiber Bidco Spa 11.00% 22 - 25.10.27	1 600 000	EUR	1 683 237	1 744 867	0,13
Fiber Bidco SpA FRN 22 - 25.10.27	3 200 000	EUR	3 186 104	3 248 784	0,24
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.625% 22 - 01.08.27	1 650 000	EUR	1 543 499	1 529 550	0,11
Golden Goose SpA FRN 21 - 14.05.27	2 000 000	EUR	1 967 765	2 006 503	0,15
Guala Closures SpA 3.25% 21 - 15.06.28	2 300 000	EUR	2 093 305	2 156 595	0,16
Guala Closures SpA FRN 23 - 29.06.29	1 600 000	EUR	1 590 289	1 622 880	0,12
Illimity Bank SpA 6.625% 22 - 09.12.25	1 200 000	EUR	1 202 105	1 229 450	0,09
IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 20 - 15.01.28	3 900 000	EUR	3 629 201	3 627 975	0,27
IMA Industria Macchine Automatiche SpA FRN 20 - 15.01.28	1 950 000	EUR	1 922 383	1 947 156	0,14

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA 5.50% 23 - 17.05.27	1 400 000	EUR	1 410 450	1 260 208	0,09
Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.625% 20 - 21.10.28	3 500 000	EUR	3 220 114	3 236 899	0,24
Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.75% 21 - 19.04.31	2 300 000	EUR	2 006 651	2 067 420	0,15
Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.875% 20 - 08.07.26	4 450 000	EUR	4 297 221	4 273 676	0,32
International Design Group SpA 10.00% 23 - 15.11.28	1 900 000	EUR	1 913 176	1 968 875	0,15
International Design Group SPA FRN 21 - 15.05.26	2 150 000	EUR	2 121 298	2 118 134	0,16
Intesa Sanpaolo SpA 2.855% 15 - 23.04.25	2 150 000	EUR	2 124 436	2 125 490	0,16
Intesa Sanpaolo SpA 2.925% 20 - 14.10.30	2 300 000	EUR	2 032 236	2 096 100	0,16
Intesa Sanpaolo Vita SpA 2.375% 20 - 22.12.30	2 750 000	EUR	2 285 478	2 199 106	0,16
Italmatch Chemicals SpA FRN 23 - 06.02.28	1 800 000	EUR	1 753 411	1 788 750	0,13
Italmatch Chemicals SpA 10.00% 23 - 06.02.28	1 400 000	EUR	1 406 752	1 438 824	0,11
Itelyum Regeneration Spa 4.625% 21 - 01.10.26	2 200 000	EUR	2 063 297	2 070 671	0,15
Kepler SpA FRN 22 - 15.05.29	1 400 000	EUR	1 381 901	1 409 537	0,10
Libra Groupco SpA 5.00% 21 - 15.05.27	1 450 000	EUR	1 327 398	1 388 893	0,10
Limacorporate SpA FRN 23 - 01.02.28	1 400 000	EUR	1 389 326	1 414 047	0,11
Lottomatica SpA 7.125% 23 - 01.06.28	2 600 000	EUR	2 657 898	2 735 146	0,20
Lottomatica SpA FRN 23 - 15.12.30	2 300 000	EUR	2 326 992	2 316 129	0,17
Lottomatica SpA FRN 23 - 01.06.28	2 500 000	EUR	2 503 928	2 521 875	0,19
Lottomatica SpA 9.75% 22 - 30.09.27	1 600 000	EUR	1 674 632	1 728 659	0,13
Marcolin SpA 6.125% 21 - 15.11.26	1 600 000	EUR	1 498 165	1 525 404	0,11
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 3.75% 16 - 16.06.26	1 400 000	EUR	1 394 197	1 387 834	0,10
Mediocredito Centrale - Banca Del Mezzogiorno SpA 1.50% 19 - 24.10.24	1 300 000	EUR	1 272 148	1 265 329	0,09
Mooney Group SpA FRN 19 - 17.12.26	2 310 000	EUR	2 277 460	2 262 388	0,17
Multiversity SRL FRN 21 - 30.10.28	3 400 000	EUR	3 361 280	3 407 792	0,25
Mundys SpA 1.625% 17 - 03.02.25	3 400 000	EUR	3 326 510	3 293 455	0,25
Mundys SpA 1.875% 17 - 13.07.27	4 500 000	EUR	4 162 179	4 197 002	0,31
Mundys SpA 1.875% 21 - 12.02.28	4 500 000	EUR	4 113 046	4 130 732	0,31
Nexi SpA 1.625% 21 - 30.04.26	4 200 000	EUR	3 979 399	3 974 433	0,30
Nexi SpA 1.75% 19 - 31.10.24	2 200 000	EUR	2 165 022	2 152 513	0,16
Nexi SpA 2.125% 21 - 30.04.29	4 800 000	EUR	4 267 315	4 230 000	0,31
Piaggio & C SpA 6.50% 23 - 05.10.30	1 100 000	EUR	1 106 608	1 153 571	0,09
Pro-Gest SpA 3.25% 17 - 15.12.24	1 100 000	EUR	903 122	572 000	0,04
Rekeep SpA 7.25% 21 - 01.02.26	1 700 000	EUR	1 619 499	1 514 417	0,11
Reno de Medici SpA FRN 21 - 14.12.26	2 000 000	EUR	1 949 482	1 998 833	0,15
Shiba Bidco SpA 4.50% 21 - 31.10.28	2 600 000	EUR	2 385 113	2 432 219	0,18
TeamSystem SpA 3.50% 21 - 15.02.28	1 400 000	EUR	1 276 564	1 293 278	0,10
TeamSystem SpA FRN 21 - 15.02.28	3 900 000	EUR	3 839 092	3 866 889	0,29
Telecom Italia SpA 1.625% 21 - 18.01.29	3 900 000	EUR	3 303 531	3 366 836	0,25
Telecom Italia SpA 2.375% 17 - 12.10.27	4 800 000	EUR	4 383 238	4 474 141	0,33
Telecom Italia SpA 2.75% 19 - 15.04.25	4 000 000	EUR	3 910 444	3 888 450	0,29
Telecom Italia SpA 2.875% 18 - 28.01.26	3 000 000	EUR	2 877 604	2 898 836	0,22
Telecom Italia SpA 3.00% 16 - 30.09.25	3 900 000	EUR	3 804 656	3 798 144	0,28

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Telecom Italia SpA 3.625% 16 - 19.01.24	1 620 000	EUR	1 619 246	1 613 881	0,12
Telecom Italia SpA 3.625% 16 - 25.05.26	3 900 000	EUR	3 818 440	3 824 997	0,28
Telecom Italia SpA 4.00% 19 - 11.04.24	3 700 000	EUR	3 698 659	3 678 514	0,27
Telecom Italia SpA 6.875% 23 - 15.02.28	5 010 000	EUR	5 047 906	5 326 405	0,40
Telecom Italia SpA 7.875% 23 - 31.07.28	5 900 000	EUR	6 103 987	6 544 768	0,49
UnipolSai Assicurazioni SpA 3.875% 18 - 01.03.28	2 300 000	EUR	2 244 125	2 262 435	0,17
Webuild SpA 1.75% 17 - 26.10.24	1 200 000	EUR	1 173 003	1 171 809	0,09
Webuild SpA 3.625% 20 - 28.01.27	1 100 000	EUR	1 012 724	1 040 787	0,08
Webuild SpA 3.875% 22 - 28.07.26	1 800 000	EUR	1 701 312	1 760 681	0,13
Webuild SpA 5.875% 20 - 15.12.25	2 300 000	EUR	2 284 037	2 338 106	0,17
Webuild SpA 7.00% 23 - 27.09.28	2 100 000	EUR	2 099 705	2 188 788	0,16
			210 320 672	211 041 317	15,69
Japon					
SoftBank Group Corp. 2.125% 21 - 06.07.24	2 860 000	EUR	2 819 121	2 803 001	0,21
SoftBank Group Corp. 2.875% 21 - 06.01.27	2 000 000	EUR	1 821 648	1 862 943	0,14
SoftBank Group Corp. 3.125% 17 - 19.09.25	3 200 000	EUR	3 096 607	3 090 781	0,23
SoftBank Group Corp. 3.375% 21 - 06.07.29	2 300 000	EUR	2 033 912	2 052 959	0,15
SoftBank Group Corp. 4.50% 18 - 20.04.25	1 200 000	EUR	1 183 319	1 188 709	0,09
SoftBank Group Corp. 4.75% 15 - 30.07.25	2 800 000	EUR	2 782 520	2 793 210	0,21
SoftBank Group Corp. 5.00% 18 - 15.04.28	4 800 000	EUR	4 610 087	4 745 151	0,35
			18 347 214	18 536 754	1,38
Jersey					
Avis Budget Finance PLC 4.75% 18 - 30.01.26	1 680 000	EUR	1 659 555	1 675 615	0,12
Avis Budget Finance PLC 7.25% 23 - 31.07.30	1 780 000	EUR	1 788 549	1 901 391	0,14
G City Europe Ltd. 4.25% 18 - 11.09.25	1 700 000	EUR	1 588 802	1 556 759	0,12
Kane Bidco Ltd. 5.00% 22 - 15.02.27	1 500 000	EUR	1 423 495	1 438 125	0,11
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3.25% 15 - 12.11.25	2 100 000	EUR	1 922 352	1 897 836	0,14
Oriflame Investment Holdings PLC FRN 21 - 04.05.26	1 150 000	EUR	708 957	330 241	0,02
TVL Finance PLC FRN 23 - 28.04.28	1 020 000	EUR	1 008 136	1 039 671	0,08
			10 099 846	9 839 638	0,73
Lituanie					
Akropolis Group Uab 2.875% 21 - 02.06.26	1 400 000	EUR	1 271 751	1 262 144	0,09
			1 271 751	1 262 144	0,09
Luxembourg					
Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc. 5.25% 21 - 15.10.26	1 900 000	EUR	1 822 963	1 894 854	0,14
Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp. / Atlas Luxco 4 Sarl 3.625% 21 - 01.06.28	3 800 000	EUR	3 363 295	3 323 643	0,25
Altice Financing SA 2.25% 20 - 15.01.25	2 700 000	EUR	2 613 835	2 616 377	0,20
Altice Financing SA 3.00% 20 - 15.01.28	4 950 000	EUR	4 296 094	4 397 621	0,33
Altice Financing SA 4.25% 21 - 15.08.29	3 700 000	EUR	3 187 634	3 262 167	0,24
Altice Finco SA 4.75% 17 - 15.01.28	3 100 000	EUR	2 537 889	2 551 964	0,19
Altice France Holdings SA 4.00% 20 - 15.02.28	2 250 000	EUR	1 450 584	977 500	0,07
Altice France Holdings SA 8.00% 20 - 15.05.27	6 000 000	EUR	4 544 912	3 399 375	0,25
AnaCap Financial Europe SA SICAV-RAIF FRN 17 - 01.08.24	1 500 000	EUR	1 111 708	975 000	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Aramark International Finance Sarl 3.125% 17 - 01.04.25	1 350 000	EUR	1 326 786	1 337 673	0,10
Arena Luxembourg Finance Sarl 1.875% 20 - 01.02.28	2 100 000	EUR	1 825 294	1 867 800	0,14
BK LC Lux Finco1 Sarl 5.25% 21 - 30.04.29	1 940 000	EUR	1 863 129	1 924 980	0,14
Cidron Aida Finco Sarl 5.00% 21 - 01.04.28	2 900 000	EUR	2 692 374	2 787 766	0,21
Cirsa Finance International Sarl 4.50% 21 - 15.03.27	2 700 000	EUR	2 545 339	2 592 482	0,19
Cirsa Finance International Sarl 4.75% 19 - 22.05.25	1 800 000	EUR	1 771 488	1 797 743	0,13
Cirsa Finance International Sarl 7.875% 23 - 31.07.28	1 800 000	EUR	1 816 101	1 874 076	0,14
Cirsa Finance International Sarl FRN 23 - 31.07.28	1 400 000	EUR	1 400 397	1 411 106	0,11
Cirsa Finance International Sarl 10.375% 22 - 30.11.27	1 900 000	EUR	1 999 666	2 068 031	0,15
Consolidated Energy Finance SA 5.00% 21 - 15.10.28	1 200 000	EUR	1 040 301	970 687	0,07
ContourGlobal Power Holdings SA 2.75% 20 - 01.01.26	2 000 000	EUR	1 878 855	1 908 875	0,14
ContourGlobal Power Holdings SA 3.125% 20 - 01.01.28	1 200 000	EUR	1 042 631	1 053 623	0,08
Cullinan Holdco Scsp 4.625% 21 - 15.10.26	1 720 000	EUR	1 498 311	1 330 850	0,10
Cullinan Holdco Scsp FRN 21 - 15.10.26	1 100 000	EUR	1 008 269	886 875	0,07
Dana Financing Luxembourg Sarl 3.00% 21 - 15.07.29	1 550 000	EUR	1 331 597	1 365 200	0,10
Dana Financing Luxembourg Sarl 8.50% 23 - 15.07.31	2 000 000	EUR	2 047 021	2 184 697	0,16
Ephios Subco 3 Sarl 7.875% 23 - 31.01.31	2 100 000	EUR	2 197 902	2 162 804	0,16
Flamingo Lux II SCA 5.00% 21 - 31.03.29	1 200 000	EUR	979 854	879 164	0,07
Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 20 - 01.11.25	3 600 000	EUR	3 146 602	2 848 500	0,21
Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 20 - 01.05.26	2 900 000	EUR	2 593 114	2 326 670	0,17
GTC Aurora Luxembourg SA 2.25% 21 - 23.06.26	2 200 000	EUR	1 544 122	1 623 735	0,12
Herens Midco Sarl 5.25% 21 - 15.05.29	2 050 000	EUR	1 522 673	1 219 109	0,09
HSE Finance Sarl 5.625% 21 - 15.10.26	1 700 000	EUR	1 276 941	896 484	0,07
HSE Finance Sarl FRN 21 - 15.10.26	1 200 000	EUR	872 518	666 000	0,05
InPost SA 2.25% 21 - 15.07.27	2 100 000	EUR	1 923 265	1 943 983	0,15
Kleopatra Finco Sarl 4.25% 21 - 01.03.26	1 810 000	EUR	1 598 037	1 492 420	0,11
Kleopatra Holdings 2 SCA 6.50% 21 - 01.09.26	1 350 000	EUR	1 047 841	720 563	0,05
Lion / Polaris Lux 4 SA FRN 21 - 01.07.26	3 000 000	EUR	2 972 138	2 989 760	0,22
Loarre Investments Sarl 6.50% 22 - 15.05.29	2 350 000	EUR	2 261 016	2 311 225	0,17
Loarre Investments Sarl FRN 22 - 15.05.29	1 400 000	EUR	1 379 260	1 403 350	0,10
Lune Holdings Sarl 5.625% 21 - 15.11.28	2 050 000	EUR	1 789 991	1 659 646	0,12
Matterhorn Telecom SA 2.625% 19 - 15.09.24	1 200 000	EUR	1 189 648	1 183 234	0,09
Matterhorn Telecom SA 3.125% 19 - 15.09.26	3 100 000	EUR	2 958 240	2 995 922	0,22
Matterhorn Telecom SA 4.00% 17 - 15.11.27	1 630 000	EUR	1 567 827	1 601 942	0,12
Monitchem HoldCo 3 SA 8.75% 23 - 01.05.28	1 900 000	EUR	1 899 140	1 934 727	0,14
Monitchem HoldCo 3 SA FRN 23 - 01.05.28	1 100 000	EUR	1 090 711	1 106 770	0,08
Motion Finco Sarl 7.375% 23 - 15.06.30	3 200 000	EUR	3 192 260	3 260 893	0,24
Mytilineos Financial Partners SA 2.50% 19 - 01.12.24	2 150 000	EUR	2 122 126	2 110 532	0,16
Picard Bondco SA 5.375% 21 - 01.07.27	1 400 000	EUR	1 267 971	1 305 500	0,10
PLT VII Finance Sarl 4.625% 20 - 05.01.26	2 200 000	EUR	2 154 359	2 180 513	0,16
PLT VII Finance Sarl FRN 20 - 05.01.26	1 000 000	EUR	996 509	1 001 131	0,08
Rossini Sarl 6.75% 18 - 30.10.25	2 900 000	EUR	2 918 281	2 900 943	0,22
Rossini Sarl FRN 19 - 30.10.25	3 000 000	EUR	2 985 504	3 000 555	0,22
Samsonite Finco Sarl 3.50% 18 - 15.05.26	1 400 000	EUR	1 349 062	1 370 208	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Sani / Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.625% 21 - 15.12.26	1 350 000	EUR	1 289 524	1 272 535	0,10
SIG Combibloc PurchaseCo Sarl 2.125% 20 - 18.06.25	2 430 000	EUR	2 384 884	2 375 994	0,18
Stena International SA 3.75% 20 - 01.02.25	1 400 000	EUR	1 374 568	1 386 565	0,10
Stena International SA 7.25% 23 - 15.02.28	1 500 000	EUR	1 544 365	1 586 577	0,12
Summer BC Holdco A Sarl 9.25% 19 - 31.10.27	1 910 232	EUR	1 708 244	1 701 444	0,13
Summer BC Holdco B SARL 5.75% 19 - 31.10.26	4 600 000	EUR	4 360 400	4 396 450	0,33
Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 17 - 01.03.28	2 000 000	EUR	1 901 383	1 900 707	0,14
Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 17 - 01.03.28	500 000	EUR	471 278	475 177	0,04
			119 848 031	116 952 697	8,70
Mexique					
Cemex SAB de CV 3.125% 19 - 19.03.26	1 680 000	EUR	1 635 341	1 645 333	0,12
Nemak SAB de CV 2.25% 21 - 20.07.28	2 300 000	EUR	2 015 403	2 034 442	0,15
			3 650 744	3 679 775	0,27
Pays-Bas					
Ashland Services BV 2.00% 20 - 30.01.28	2 300 000	EUR	2 100 295	2 129 779	0,16
Boels Topholding BV 6.25% 23 - 15.02.29	1 800 000	EUR	1 805 098	1 875 283	0,14
Citycon Treasury BV 1.25% 16 - 08.09.26	1 500 000	EUR	1 263 419	1 303 039	0,10
Citycon Treasury BV 1.625% 21 - 12.03.28	1 600 000	EUR	1 234 991	1 274 686	0,10
Compact Bidco BV 5.75% 21 - 01.05.26	1 400 000	EUR	1 078 533	659 750	0,05
Darling Global Finance BV 3.625% 18 - 15.05.26	2 200 000	EUR	2 160 756	2 167 547	0,16
Dufry One BV 2.00% 19 - 15.02.27	3 370 000	EUR	3 069 657	3 142 484	0,23
Dufry One BV 2.50% 17 - 15.10.24	3 550 000	EUR	3 505 080	3 488 967	0,26
Dufry One BV 3.375% 21 - 15.04.28	3 300 000	EUR	3 060 768	3 138 600	0,23
Energizer Gamma Acquisition BV 3.50% 21 - 30.06.29	3 000 000	EUR	2 614 154	2 582 749	0,19
Goodyear Europe BV 2.75% 21 - 15.08.28	1 750 000	EUR	1 570 847	1 616 507	0,12
IPD 3 BV 8.00% 23 - 15.06.28	2 350 000	EUR	2 411 444	2 503 901	0,19
IPD 3 BV FRN 23 - 15.06.28	2 000 000	EUR	2 007 641	2 025 634	0,15
Maxeda DIY Holdings BV 5.875% 20 - 01.10.26	2 200 000	EUR	1 826 193	1 650 611	0,12
Metinvest BV 5.625% 19 - 17.06.25	1 350 000	EUR	1 120 136	1 048 049	0,08
Nobian Finance BV 3.625% 21 - 15.07.26	2 430 000	EUR	2 254 684	2 330 522	0,17
OI European Group BV 2.875% 19 - 15.02.25	2 210 000	EUR	2 181 546	2 179 616	0,16
OI European Group BV 6.25% 23 - 15.05.28	2 700 000	EUR	2 757 200	2 822 240	0,21
Phoenix PIB Dutch Finance BV 2.375% 20 - 05.08.25	1 700 000	EUR	1 651 719	1 650 206	0,12
PPF Telecom Group BV 2.125% 19 - 31.01.25	2 700 000	EUR	2 650 780	2 635 033	0,20
PPF Telecom Group BV 3.125% 19 - 27.03.26	2 450 000	EUR	2 405 549	2 399 243	0,18
PPF Telecom Group BV 3.25% 20 - 29.09.27	2 250 000	EUR	2 154 213	2 184 381	0,16
Q-Park Holdings I BV 1.50% 20 - 01.03.25	1 850 000	EUR	1 795 388	1 811 613	0,13
Q-Park Holdings I BV 2.00% 20 - 01.03.27	2 900 000	EUR	2 648 403	2 676 700	0,20
Q-Park Holdings I BV FRN 20 - 01.03.26	1 900 000	EUR	1 861 204	1 888 125	0,14
Saipem Finance International BV 2.625% 17 - 07.01.25	1 700 000	EUR	1 661 023	1 666 708	0,12
Saipem Finance International BV 3.125% 21 - 31.03.28	2 300 000	EUR	2 121 381	2 161 340	0,16

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Saipem Finance International BV 3.375% 20 - 15.07.26	2 250 000	EUR	2 173 781	2 180 575	0,16
Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV 1.80% 17 - 06.07.24	1 300 000	EUR	1 278 113	1 277 556	0,10
Sigma Holdco BV 5.75% 18 - 15.05.26	3 100 000	EUR	2 749 124	2 762 875	0,21
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.125% 16 - 15.10.24	2 700 000	EUR	2 631 595	2 619 627	0,20
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 21 - 09.05.27	5 000 000	EUR	4 700 017	4 811 772	0,36
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.375% 21 - 09.05.30	6 800 000	EUR	6 126 057	6 369 221	0,47
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 18 - 01.03.25	2 200 000	EUR	2 186 957	2 194 812	0,16
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 6.00% 20 - 31.01.25	1 900 000	EUR	1 915 997	1 917 832	0,14
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.375% 23 - 15.09.29	3 600 000	EUR	3 694 198	3 931 333	0,29
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.875% 23 - 15.09.31	2 300 000	EUR	2 400 995	2 602 297	0,19
Titan Holdings II BV 5.125% 21 - 15.07.29	1 750 000	EUR	1 506 685	1 491 105	0,11
TMNL Holdings BV 3.75% 21 - 15.01.29	3 600 000	EUR	3 311 350	3 409 205	0,25
Trivium Packaging Finance BV 3.75% 19 - 15.08.26	2 800 000	EUR	2 669 327	2 707 600	0,20
Trivium Packaging Finance BV FRN 19 - 15.08.26	1 610 000	EUR	1 589 233	1 608 323	0,12
United Group BV 3.125% 20 - 15.02.26	2 700 000	EUR	2 515 020	2 583 562	0,19
United Group BV 3.625% 20 - 15.02.28	2 800 000	EUR	2 412 998	2 585 940	0,19
United Group BV 4.00% 20 - 15.11.27	2 500 000	EUR	2 230 714	2 357 393	0,18
United Group BV 4.625% 21 - 15.08.28	1 400 000	EUR	1 240 785	1 323 012	0,10
United Group BV 5.25% 22 - 01.02.30	2 300 000	EUR	2 057 557	2 169 504	0,16
United Group BV FRN 20 - 15.02.26	2 000 000	EUR	1 938 692	1 993 000	0,15
United Group BV FRN 22 - 01.02.29	2 200 000	EUR	2 123 766	2 203 143	0,16
Versuni Group BV 3.125% 21 - 15.06.28	3 000 000	EUR	2 576 940	2 619 025	0,19
Villa Dutch Bidco BV 9.00% 22 - 03.11.29	1 900 000	EUR	1 842 465	1 963 477	0,15
VZ Secured Financing BV 3.50% 22 - 15.01.32	3 400 000	EUR	2 909 781	2 992 242	0,22
VZ Vendor Financing II BV 2.875% 20 - 15.01.29	3 200 000	EUR	2 751 633	2 799 821	0,21
Wizz Air Finance Co. BV 1.00% 22 - 19.01.26	2 200 000	EUR	1 974 644	2 019 334	0,15
Wp / ap Telecom Holdings III BV 5.50% 21 - 15.01.30	2 600 000	EUR	2 357 014	2 366 750	0,18
ZF Europe Finance BV 2.00% 19 - 23.02.26	4 100 000	EUR	3 881 893	3 902 369	0,29
ZF Europe Finance BV 2.50% 19 - 23.10.27	2 700 000	EUR	2 494 241	2 519 701	0,19
ZF Europe Finance BV 3.00% 19 - 23.10.29	3 200 000	EUR	2 888 469	2 933 280	0,22
ZF Europe Finance BV 6.125% 23 - 13.03.29	3 000 000	EUR	3 032 484	3 181 321	0,24
Ziggo Bond Co. BV 3.375% 20 - 28.02.30	4 100 000	EUR	3 493 058	3 455 591	0,26
Ziggo BV 2.875% 19 - 15.01.30	2 250 000	EUR	1 938 961	2 000 813	0,15
			142 566 646	144 866 724	10,77
Norvège					
Adevinta ASA 2.625% 20 - 15.11.25	2 850 000	EUR	2 800 587	2 820 523	0,21
Adevinta ASA 3.00% 20 - 15.11.27	1 950 000	EUR	1 870 651	1 937 244	0,14

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Axactor ASA FRN 21 - 15.09.26	1 400 000	EUR	1 340 866	1 314 833	0,10
B2 Impact ASA FRN 22 - 22.09.26	1 400 000	EUR	1 395 708	1 422 750	0,11
			7 407 812	7 495 350	0,56
Panama					
Carnival Corp. 7.625% 20 - 01.03.26	2 250 000	EUR	2 202 171	2 285 119	0,17
			2 202 171	2 285 119	0,17
Pologne					
Canpack SA / Canpack US LLC 2.375% 20 - 01.11.27	2 800 000	EUR	2 503 179	2 555 158	0,19
Synthos SA 2.50% 21 - 07.06.28	2 700 000	EUR	2 329 524	2 287 012	0,17
			4 832 703	4 842 170	0,36
Portugal					
Transportes Aereos Portugueses SA 5.625% 19 - 02.12.24	1 700 000	EUR	1 659 891	1 684 455	0,13
			1 659 891	1 684 455	0,13
Roumanie					
RCS & RDS SA 2.50% 20 - 05.02.25	1 900 000	EUR	1 846 054	1 854 617	0,14
RCS & RDS SA 3.25% 20 - 05.02.28	1 800 000	EUR	1 611 401	1 601 275	0,12
			3 457 455	3 455 892	0,26
Espagne					
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA 1.375% 20 - 17.06.25	3 400 000	EUR	3 308 287	3 279 069	0,24
Aedas Homes Opco SLU 4.00% 21 - 15.08.26	1 500 000	EUR	1 430 806	1 411 250	0,11
Almirall SA 2.125% 21 - 30.09.26	1 200 000	EUR	1 144 461	1 150 852	0,09
Banco de Sabadell SA 1.125% 19 - 27.03.25	2 300 000	EUR	2 270 624	2 226 672	0,17
Banco de Sabadell SA 1.75% 19 - 10.05.24	1 900 000	EUR	1 885 444	1 884 427	0,14
Banco de Sabadell SA 5.625% 16 - 06.05.26	2 300 000	EUR	2 352 293	2 345 839	0,17
Cellnex Finance Co. SA 0.75% 21 - 15.11.26	2 300 000	EUR	2 128 955	2 127 274	0,16
Cellnex Finance Co. SA 1.00% 21 - 15.09.27	4 600 000	EUR	4 200 658	4 207 890	0,31
Cellnex Finance Co. SA 1.25% 21 - 15.01.29	3 400 000	EUR	2 983 396	3 031 213	0,23
Cellnex Finance Co. SA 1.50% 21 - 08.06.28	4 500 000	EUR	4 110 290	4 119 900	0,31
Cellnex Finance Co. SA 2.25% 22 - 12.04.26	4 500 000	EUR	4 339 517	4 368 040	0,32
Cellnex Telecom SA 1.00% 20 - 20.04.27	2 000 000	EUR	1 831 924	1 846 433	0,14
Cellnex Telecom SA 1.75% 20 - 23.10.30	4 500 000	EUR	3 958 601	3 946 115	0,29
Cellnex Telecom SA 1.875% 20 - 26.06.29	3 400 000	EUR	3 063 589	3 100 227	0,23
Cellnex Telecom SA 2.375% 16 - 16.01.24	3 300 000	EUR	3 299 300	3 297 122	0,25
Cellnex Telecom SA 2.875% 17 - 18.04.25	2 300 000	EUR	2 281 987	2 278 636	0,17
eDreams ODIGEO SA 5.50% 22 - 15.07.27	1 800 000	EUR	1 693 019	1 790 100	0,13
Eroski S Coop 10.625% 23 - 30.04.29	2 300 000	EUR	2 305 261	2 359 656	0,18
Food Service Project SA 5.50% 22 - 21.01.27	1 400 000	EUR	1 368 454	1 393 389	0,10
Gestamp Automocion SA 3.25% 18 - 30.04.26	1 850 000	EUR	1 793 137	1 814 053	0,13
Green Bidco SA 10.25% 23 - 15.07.28	1 300 000	EUR	1 241 856	1 139 775	0,08
Grifols Escrow Issuer SA 3.875% 21 - 15.10.28	6 400 000	EUR	5 766 591	5 834 587	0,43
Grifols SA 1.625% 19 - 15.02.25	3 800 000	EUR	3 724 082	3 700 529	0,28
Grifols SA 2.25% 19 - 15.11.27	3 300 000	EUR	3 059 008	3 099 404	0,23
Grifols SA 3.20% 17 - 01.05.25	4 590 000	EUR	4 474 480	4 478 738	0,33
Grupo Antolin-Irausa SA 3.375% 18 - 30.04.26	1 150 000	EUR	1 009 624	1 012 164	0,08
Grupo Antolin-Irausa SA 3.50% 21 - 30.04.28	1 700 000	EUR	1 397 660	1 288 175	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
International Consolidated Airlines Group SA 1.50% 19 - 04.07.27	2 300 000	EUR	2 031 844	2 123 475	0,16
International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 21 - 25.03.25	1 800 000	EUR	1 757 522	1 763 648	0,13
International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 21 - 25.03.25	400 000	EUR	384 780	391 922	0,03
International Consolidated Airlines Group SA 3.75% 21 - 25.03.29	3 200 000	EUR	2 940 326	3 100 327	0,23
Kaixo Bondco Telecom SA 5.125% 21 - 30.09.29	2 300 000	EUR	2 105 735	2 148 775	0,16
Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 20 - 18.09.27	10 700 000	EUR	10 225 811	10 408 119	0,77
NH Hotel Group SA 4.00% 21 - 02.07.26	1 700 000	EUR	1 642 362	1 679 002	0,12
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA 5.25% 21 - 01.04.26	1 100 000	EUR	1 051 311	1 048 586	0,08
			94 562 995	95 195 383	7,08
Suède					
Assemblin Group AB FRN 23 - 05.07.29	2 000 000	EUR	1 978 805	2 029 500	0,15
Dometic Group AB 2.00% 21 - 29.09.28	1 300 000	EUR	1 127 499	1 126 403	0,08
Dometic Group AB 3.00% 19 - 08.05.26	1 400 000	EUR	1 358 860	1 368 879	0,10
Heimstaden AB 4.25% 21 - 09.03.26	1 600 000	EUR	1 065 096	750 533	0,06
Heimstaden AB 4.375% 21 - 06.03.27	1 800 000	EUR	1 353 077	739 463	0,05
Intrum AB 3.00% 19 - 15.09.27	3 900 000	EUR	3 201 415	2 942 411	0,22
Intrum AB 3.125% 17 - 15.07.24	2 136 555	EUR	2 102 122	2 093 736	0,16
Intrum AB 3.50% 19 - 15.07.26	3 600 000	EUR	3 147 336	3 044 481	0,23
Intrum AB 4.875% 20 - 15.08.25	3 800 000	EUR	3 617 135	3 544 239	0,26
Intrum AB 9.25% 22 - 15.03.28	2 100 000	EUR	1 963 710	1 907 062	0,14
Ren10 Holdings AB FRN 22 - 01.02.27	1 600 000	EUR	1 572 827	1 593 829	0,12
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 2.25% 20 - 12.08.27	3 400 000	EUR	2 390 957	2 261 000	0,17
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 2.375% 19 - 04.09.26	2 300 000	EUR	1 737 793	1 655 117	0,12
Transcom Holdings AB FRN 21 - 15.12.26	1 400 000	EUR	1 385 596	1 400 000	0,10
Verisure Holdings AB 3.25% 21 - 15.02.27	5 200 000	EUR	4 888 280	4 980 950	0,37
Verisure Holdings AB 3.875% 20 - 15.07.26	3 600 000	EUR	3 483 403	3 530 560	0,26
Verisure Holdings AB 7.125% 23 - 01.02.28	2 100 000	EUR	2 122 149	2 208 931	0,16
Verisure Holdings AB 9.25% 22 - 15.10.27	2 200 000	EUR	2 314 046	2 361 714	0,18
Verisure Midholding AB 5.25% 21 - 15.02.29	5 300 000	EUR	4 830 222	5 048 899	0,38
Volvo Car AB 2.00% 17 - 24.01.25	2 220 000	EUR	2 182 262	2 167 076	0,16
Volvo Car AB 2.125% 19 - 02.04.24	2 650 000	EUR	2 641 800	2 627 210	0,20
Volvo Car AB 2.50% 20 - 07.10.27	2 300 000	EUR	2 174 573	2 172 860	0,16
Volvo Car AB 4.25% 22 - 31.05.28	2 300 000	EUR	2 249 923	2 311 399	0,17
			54 888 886	53 866 252	4,00
Turquie					
Arcelik AS 3.00% 21 - 27.05.26	1 600 000	EUR	1 508 802	1 524 736	0,11
			1 508 802	1 524 736	0,11
Royaume-Uni					
Allwyn Entertainment Financing UK PLC 7.25% 23 - 30.04.30	3 100 000	EUR	3 149 688	3 256 411	0,24

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Allwyn Entertainment Financing UK PLC FRN 22 - 15.02.28	1 700 000	EUR	1 688 265	1 726 799	0,13
BCP V Modular Services Finance II PLC 4.75% 21 - 30.11.28	3 400 000	EUR	3 091 386	3 138 975	0,23
BCP V Modular Services Finance PLC 6.75% 21 - 30.11.29	2 000 000	EUR	1 675 422	1 627 947	0,12
Canary Wharf Group Investment Holdings PLC 1.75% 21 - 07.04.26	1 400 000	EUR	1 141 880	1 128 767	0,08
Carnival PLC 1.00% 19 - 28.10.29	2 800 000	EUR	1 940 411	2 009 242	0,15
Castle UK Finco PLC FRN 22 - 15.05.28	2 100 000	EUR	1 873 099	1 932 000	0,14
Deuce Finco PLC FRN 21 - 15.06.27	1 200 000	EUR	1 162 154	1 204 913	0,09
Drax Finco PLC 2.625% 20 - 01.11.25	1 000 000	EUR	953 439	964 199	0,07
EC Finance PLC 3.00% 21 - 15.10.26	2 100 000	EUR	2 000 583	2 021 670	0,15
eG Global Finance PLC 11.00% 23 - 30.11.28	2 100 000	EUR	2 259 726	2 229 102	0,17
Iceland Bondco PLC FRN 23 - 15.12.27	1 200 000	EUR	1 188 793	1 198 823	0,09
INEOS Finance PLC 2.125% 17 - 15.11.25	2 530 000	EUR	2 435 312	2 441 782	0,18
INEOS Finance PLC 2.875% 19 - 01.05.26	3 550 000	EUR	3 398 488	3 435 828	0,26
INEOS Finance PLC 3.375% 20 - 31.03.26	1 500 000	EUR	1 449 799	1 467 782	0,11
INEOS Finance PLC 6.625% 23 - 15.05.28	1 800 000	EUR	1 799 868	1 841 576	0,14
INEOS Quattro Finance 1 PLC 3.75% 21 - 15.07.26	1 600 000	EUR	1 460 859	1 537 154	0,11
INEOS Quattro Finance 2 PLC 2.50% 21 - 15.01.26	1 800 000	EUR	1 699 893	1 739 340	0,13
INEOS Quattro Finance 2 PLC 8.50% 23 - 15.03.29	2 500 000	EUR	2 561 404	2 635 117	0,20
International Game Technology PLC 2.375% 19 - 15.04.28	2 250 000	EUR	2 058 287	2 082 036	0,15
International Game Technology PLC 3.50% 19 - 15.06.26	3 400 000	EUR	3 342 748	3 368 514	0,25
International Personal Finance PLC 9.75% 20 - 12.11.25	1 550 000	EUR	1 477 769	1 509 312	0,11
Jaguar Land Rover Automotive PLC 2.20% 17 - 15.01.24	3 000 000	EUR	2 997 353	2 987 318	0,22
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4.50% 18 - 15.01.26	2 300 000	EUR	2 224 089	2 299 212	0,17
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4.50% 21 - 15.07.28	2 300 000	EUR	2 149 189	2 242 026	0,17
Jaguar Land Rover Automotive PLC 5.875% 19 - 15.11.24	2 250 000	EUR	2 253 014	2 259 280	0,17
Jaguar Land Rover Automotive PLC 6.875% 19 - 15.11.26	1 300 000	EUR	1 332 622	1 384 291	0,10
Nomad Foods Bondco PLC 2.50% 21 - 24.06.28	3 700 000	EUR	3 404 332	3 456 972	0,26
Paysafe Finance PLC / Paysafe Holdings US Corp. 3.00% 21 - 15.06.29	1 900 000	EUR	1 626 562	1 711 425	0,13
PeopleCert Wisdom Issuer PLC 5.75% 21 - 15.09.26	1 300 000	EUR	1 269 178	1 287 000	0,10
PEU Fin PLC 7.25% 23 - 01.07.28	1 700 000	EUR	1 697 706	1 743 356	0,13
Pinnacle Bidco PLC 8.25% 23 - 11.10.28	1 700 000	EUR	1 677 182	1 764 692	0,13
Rolls-Royce PLC 0.875% 18 - 09.05.24	2 500 000	EUR	2 473 723	2 461 975	0,18
Rolls-Royce PLC 1.625% 18 - 09.05.28	2 500 000	EUR	2 221 335	2 301 229	0,17
Rolls-Royce PLC 4.625% 20 - 16.02.26	3 370 000	EUR	3 365 156	3 422 698	0,25
Sherwood Financing PLC 4.50% 21 - 15.11.26	1 700 000	EUR	1 517 424	1 555 851	0,12

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Sherwood Financing PLC FRN 21 - 15.11.27	3 000 000	EUR	2 902 439	2 945 970	0,22
SIG PLC 5.25% 21 - 30.11.26	1 350 000	EUR	1 223 716	1 215 000	0,09
Stonegate Pub Co. Financing 2019 PLC FRN 20 - 31.07.25	2 150 000	EUR	2 070 305	2 095 999	0,16
Synthomer PLC 3.875% 20 - 01.07.25	2 250 000	EUR	2 178 863	2 218 125	0,17
TI Automotive Finance PLC 3.75% 21 - 15.04.29	2 800 000	EUR	2 497 621	2 552 962	0,19
Titan Global Finance PLC 2.375% 17 - 16.11.24	1 650 000	EUR	1 624 884	1 625 440	0,12
Titan Global Finance PLC 2.75% 20 - 09.07.27	1 000 000	EUR	969 690	977 500	0,07
Victoria PLC 3.625% 21 - 24.08.26	2 150 000	EUR	1 931 273	1 714 625	0,13
Victoria PLC 3.75% 21 - 15.03.28	1 200 000	EUR	968 220	828 600	0,06
Virgin Media Finance PLC 3.75% 20 - 15.07.30	2 300 000	EUR	1 988 877	2 109 052	0,16
Vmed O2 UK Financing I PLC 3.25% 20 - 31.01.31	4 300 000	EUR	3 826 302	3 945 250	0,29
			96 200 328	97 603 137	7,26
États-Unis					
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC 2.00% 21 - 01.09.28	2 000 000	EUR	1 777 282	1 764 230	0,13
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC 3.00% 21 - 01.09.29	2 300 000	EUR	1 968 446	1 846 463	0,14
Avantor Funding Inc. 2.625% 20 - 01.11.25	3 000 000	EUR	2 935 462	2 930 131	0,22
Avantor Funding Inc. 3.875% 20 - 15.07.28	1 800 000	EUR	1 719 248	1 758 249	0,13
Ball Corp. 0.875% 19 - 15.03.24	3 400 000	EUR	3 384 604	3 362 935	0,25
Ball Corp. 1.50% 19 - 15.03.27	1 400 000	EUR	1 326 724	1 310 500	0,10
Ball Corp. 1.50% 19 - 15.03.27	1 100 000	EUR	1 016 964	1 029 679	0,08
Belden Inc. 3.375% 17 - 15.07.27	2 100 000	EUR	2 003 157	2 027 088	0,15
Belden Inc. 3.375% 21 - 15.07.31	1 350 000	EUR	1 214 988	1 185 798	0,09
Belden Inc. 3.875% 18 - 15.03.28	1 500 000	EUR	1 430 800	1 448 460	0,11
Boxer Parent Co. Inc. 6.50% 20 - 02.10.25	1 650 000	EUR	1 642 814	1 651 405	0,12
Catalent Pharma Solutions Inc. 2.375% 20 - 01.03.28	3 700 000	EUR	3 305 079	3 208 723	0,24
Chemours Co. 4.00% 18 - 15.05.26	1 800 000	EUR	1 713 725	1 765 286	0,13
Clarios Global LP / Clarios US Finance Co. 4.375% 19 - 15.05.26	3 100 000	EUR	3 032 958	3 064 763	0,23
Coty Inc. 3.875% 21 - 15.04.26	3 200 000	EUR	3 143 598	3 182 243	0,24
Coty Inc. 5.75% 23 - 15.09.28	2 300 000	EUR	2 339 923	2 416 253	0,18
Emerald Debt Merger Sub LLC 6.375% 23 - 15.12.30	2 200 000	EUR	2 221 724	2 351 214	0,17
Encore Capital Group Inc. 4.875% 20 - 15.10.25	1 600 000	EUR	1 564 703	1 593 581	0,12
Encore Capital Group Inc. FRN 20 - 15.01.28	2 200 000	EUR	2 174 740	2 202 596	0,16
Graphic Packaging International LLC 2.625% 21 - 01.02.29	1 250 000	EUR	1 116 102	1 153 862	0,08
IQVIA Inc. 1.75% 21 - 15.03.26	2 500 000	EUR	2 395 757	2 396 565	0,18
IQVIA Inc. 2.25% 19 - 15.01.28	3 200 000	EUR	2 976 377	2 999 384	0,22
IQVIA Inc. 2.25% 21 - 15.03.29	4 100 000	EUR	3 728 053	3 746 536	0,28
IQVIA Inc. 2.875% 17 - 15.09.25	1 850 000	EUR	1 820 070	1 820 688	0,13
IQVIA Inc. 2.875% 20 - 15.06.28	3 200 000	EUR	3 008 101	3 043 847	0,23
Kronos International Inc. 3.75% 17 - 15.09.25	1 700 000	EUR	1 607 055	1 618 187	0,12
Levi Strauss & Co. 3.375% 17 - 15.03.27	2 000 000	EUR	1 949 210	1 961 210	0,15
MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp. 0.993% 21 - 15.10.26	2 260 000	EUR	1 882 428	1 702 077	0,13

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp. 3.325% 17 - 24.03.25	2 200 000	EUR	2 088 812	1 982 978	0,15
Olympus Water US Holding Corp. 9.625% 23 - 15.11.28	2 800 000	EUR	2 746 263	2 993 558	0,22
Olympus Water US Holdings Corp. 3.875% 21 - 01.10.28	2 200 000	EUR	1 945 432	2 009 792	0,15
Olympus Water US Holdings Corp. 5.375% 21 - 01.10.29	1 250 000	EUR	1 018 349	1 060 045	0,08
Organon & Co. / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 2.875% 21 - 30.04.28	5 700 000	EUR	5 253 114	5 208 367	0,39
Primo Water Holdings Inc. 3.875% 20 - 31.10.28	2 050 000	EUR	1 885 122	1 969 701	0,15
SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 4.375% 21 - 01.11.26	1 450 000	EUR	1 360 745	1 406 246	0,10
SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC FRN 21 - 01.11.26	1 500 000	EUR	1 485 798	1 500 418	0,11
SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 9.50% 23 - 15.07.28	1 400 000	EUR	1 440 773	1 489 309	0,11
Silgan Holdings Inc. 2.25% 20 - 01.06.28	2 300 000	EUR	2 078 913	2 112 665	0,16
Silgan Holdings Inc. 3.25% 18 - 15.03.25	2 900 000	EUR	2 868 942	2 872 812	0,21
Spectrum Brands Inc. 4.00% 16 - 01.10.26	1 770 000	EUR	1 712 943	1 742 344	0,13
Standard Industries Inc. 2.25% 19 - 21.11.26	3 600 000	EUR	3 337 070	3 389 526	0,25
UGI International LLC 2.50% 21 - 01.12.29	1 800 000	EUR	1 553 329	1 525 378	0,11
WMG Acquisition Corp. 2.25% 21 - 15.08.31	1 900 000	EUR	1 625 263	1 661 419	0,12
WMG Acquisition Corp. 2.75% 20 - 15.07.28	1 530 000	EUR	1 424 817	1 456 254	0,11
			94 225 777	94 922 765	7,06
Total - Obligations			1 317 894 311	1 319 948 480	98,14
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	1 835	EUR	18 405 821	18 441 057	1,37
			18 405 821	18 441 057	1,37
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			18 405 821	18 441 057	1,37
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 336 300 132	1 338 389 537	99,51

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire^(A)					
Actions					
Luxembourg					
Ideal Standard International SA	1 100	EUR	—	—	0,00
			—	—	0,00
Total - Actions			—	—	0,00
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			—	—	0,00
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 336 300 132	1 338 389 537	99,51
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 355 967 399	100,82

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Aurizon Network Pty Ltd. 3.125% 16 - 01.06.26	812 000	EUR	802 393	804 522	0,93
			802 393	804 522	0,93
Autriche					
Hypo Vorarlberg Bank AG 4.125% 23 - 16.02.26	300 000	EUR	296 177	300 480	0,35
			296 177	300 480	0,35
Belgique					
Proximus SADP 1.875% 15 - 01.10.25	200 000	EUR	193 591	195 274	0,22
			193 591	195 274	0,22
Finlande					
Kojamo OYJ 1.50% 17 - 19.06.24	319 000	EUR	312 918	312 904	0,36
Kojamo OYJ 1.875% 20 - 27.05.27	292 000	EUR	257 659	261 098	0,30
			570 577	574 002	0,66
France					
Air Liquide Finance SA 1.00% 17 - 08.03.27	700 000	EUR	665 120	666 652	0,77
Air Liquide Finance SA 1.00% 20 - 02.04.25	200 000	EUR	194 462	194 454	0,22
Altice France SA 2.125% 20 - 15.02.25	4 044 000	EUR	3 812 619	3 895 504	4,48
Banijay Group SAS 6.50% 20 - 01.03.26	240 000	EUR	240 331	239 501	0,28
Constellium SE 4.25% 17 - 15.02.26	3 197 000	EUR	3 147 496	3 178 106	3,65
Credit Mutuel Arkea SA 1.25% 17 - 31.05.24	300 000	EUR	297 037	296 667	0,34
Crown European Holdings SA 3.375% 15 - 15.05.25	3 854 000	EUR	3 821 389	3 824 131	4,40
Forvia 3.125% 19 - 15.06.26	256 000	EUR	251 574	250 698	0,29
Iliad Holdings SASU 5.125% 21 - 15.10.26	4 320 000	EUR	4 329 023	4 300 949	4,95
iliad SA 2.375% 20 - 17.06.26	200 000	EUR	189 729	191 000	0,22
La Banque Postale SA 0.25% 19 - 12.07.26	300 000	EUR	274 480	279 027	0,32
Loxam SAS 2.875% 19 - 15.04.26	200 000	EUR	188 923	193 500	0,22
Novafives SAS 5.00% 18 - 15.06.25	480 000	EUR	470 978	471 562	0,54
Renault SA 1.00% 17 - 28.11.25	544 000	EUR	544 000	517 393	0,60
Renault SA 2.00% 18 - 28.09.26	2 500 000	EUR	2 500 000	2 385 025	2,74
Renault SA 2.375% 20 - 25.05.26	800 000	EUR	765 743	774 968	0,89
			21 692 904	21 659 137	24,91
Allemagne					
BASF SE 1.75% 17 - 11.03.25	5 000	GBP	5 567	5 576	0,01
Commerzbank AG 4.00% 16 - 23.03.26	480 000	EUR	477 619	482 174	0,55
Deutsche Lufthansa AG 3.00% 20 - 29.05.26	800 000	EUR	779 506	778 888	0,90
Deutsche Post AG 1.25% 16 - 01.04.26	1 000	EUR	971	971	0,00
ZF Finance GmbH 5.75% 23 - 03.08.26	200 000	EUR	205 151	206 584	0,24
			1 468 814	1 474 193	1,70
Irlande					
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc. 2.125% 19 - 15.08.26	380 000	EUR	338 487	338 409	0,39
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 2.375% 15 - 10.09.25	764 000	EUR	750 401	753 831	0,87
PartnerRe Ireland Finance Dac 1.25% 16 - 15.09.26	425 000	EUR	398 881	401 612	0,46
			1 487 769	1 493 852	1,72
Italie					
2i Rete Gas SpA 1.75% 17 - 28.08.26	3 035 000	EUR	2 853 041	2 917 758	3,36
Agenzia Nazionale per l'Attrazione degli Investimenti e lo Sviluppo d'Impresa 5.25% 22 - 14.11.25	570 000	EUR	574 883	579 565	0,67

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.875% 20 - 09.01.26	400 000	EUR	380 057	380 252	0,44
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.625% 20 - 28.04.25	240 000	EUR	231 750	234 022	0,27
Hera SpA 0.875% 16 - 14.10.26	625 000	EUR	577 507	587 687	0,68
Hera SpA 5.20% 13 - 29.01.28	720 000	EUR	776 177	777 434	0,89
Italgas SpA 1.125% 17 - 14.03.24	267 000	EUR	265 889	265 590	0,30
Nexi SpA 1.625% 21 - 30.04.26	700 000	EUR	665 938	663 446	0,76
Telecom Italia SpA 3.00% 16 - 30.09.25	700 000	EUR	684 916	682 500	0,78
Telecom Italia SpA 3.625% 16 - 25.05.26	700 000	EUR	687 719	686 336	0,79
			7 697 877	7 774 590	8,94
Japon					
Nissan Motor Co. Ltd. 144A 2.652% 20 - 17.03.26	560 000	EUR	543 279	546 510	0,63
			543 279	546 510	0,63
Luxembourg					
Cirsa Finance International Sarl 4.75% 19 - 22.05.25	3 422 000	EUR	3 397 036	3 421 829	3,94
John Deere Cash Management SARL 1.85% 20 - 02.04.28	3 955 000	EUR	3 805 767	3 819 225	4,39
Matterhorn Telecom SA 3.125% 19 - 15.09.26	857 000	EUR	829 115	829 379	0,95
Rossini Sarl 6.75% 18 - 30.10.25	240 000	EUR	240 046	240 331	0,28
Stena International SA 3.75% 20 - 01.02.25	2 356 000	EUR	2 341 099	2 338 118	2,69
Summer BC Holdco B SARL 5.75% 19 - 31.10.26	2 044 000	EUR	1 938 526	1 958 356	2,25
			12 551 589	12 607 238	14,50
Pays-Bas					
Abertis Infraestructuras Finance BV FRN 20 - 31.12.99	800 000	EUR	767 844	767 000	0,88
Airbus SE 0.875% 16 - 13.05.26	1 560 000	EUR	1 488 798	1 498 099	1,72
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 18 - 01.12.25	49 000	EUR	47 261	47 673	0,06
EnBW International Finance BV 4.875% 04 - 16.01.25	64 000	EUR	64 628	64 887	0,07
Heineken NV 1.375% 16 - 29.01.27	663 000	EUR	628 085	631 706	0,73
Naturgy Finance BV 2.875% 14 - 11.03.24	100 000	EUR	99 854	99 761	0,12
Nederlandse Gasunie NV 1.00% 16 - 11.05.26	240 000	EUR	226 095	229 596	0,26
Saipem Finance International BV 2.625% 17 - 07.01.25	880 000	EUR	866 324	864 125	0,99
TenneT Holding BV 0.75% 17 - 26.06.25	1 457 000	EUR	1 407 795	1 414 441	1,63
TenneT Holding BV 1.375% 18 - 05.06.28	2 527 000	EUR	2 349 267	2 412 375	2,77
Toyota Motor Finance Netherlands BV 0.75% 21 - 19.12.25	970 000	GBP	1 046 221	1 043 793	1,20
Trivium Packaging Finance BV 3.75% 19 - 15.08.26	252 000	EUR	243 853	243 639	0,28
			9 236 025	9 317 095	10,71
Espagne					
Banco Santander SA 1.75% 20 - 17.02.27	1 500 000	GBP	1 491 775	1 562 545	1,80
Criteria Caixa SA 1.375% 19 - 10.04.24	100 000	EUR	99 384	99 290	0,12
Grifols SA 144A 3.875% 21 - 15.10.28	800 000	EUR	676 790	732 624	0,84

Les notes complémentaires 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 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Iberdrola Finanzas SA 1.00% 16 - 07.03.24	300 000	EUR	298 758	298 425	0,34
International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 21 - 25.03.25	2 800 000	EUR	2 744 244	2 747 024	3,16
			5 310 951	5 439 908	6,26
Suède					
Essity AB 1.625% 17 - 30.03.27	714 000	EUR	662 985	683 798	0,79
Intrum AB 3.50% 19 - 15.07.26	2 960 000	EUR	2 487 864	2 509 103	2,88
			3 150 849	3 192 901	3,67
Royaume-Uni					
Barclays Bank PLC 2.25% 14 - 10.06.24	960 000	EUR	953 183	952 330	1,10
BAT International Finance PLC 4.00% 13 - 04.09.26	624 000	GBP	700 995	703 991	0,81
Burberry Group PLC 1.125% 20 - 21.09.25	403 000	GBP	428 651	435 630	0,50
Eastern Power Networks PLC 5.75% 04 - 08.03.24	210 000	GBP	242 458	242 298	0,28
Experian Finance PLC 0.739% 20 - 29.10.25	3 562 000	GBP	3 845 376	3 837 626	4,41
Jaguar Land Rover Automotive PLC 5.875% 19 - 15.11.24	959 000	EUR	965 269	966 193	1,11
London & Quadrant Housing Trust 2.625% 16 - 05.05.26	760 000	GBP	829 074	833 543	0,96
Motability Operations Group PLC 3.75% 14 - 16.07.26	231 000	GBP	255 197	262 902	0,30
Sky Ltd. 6.00% 07 - 21.05.27	3 050 000	GBP	3 683 460	3 717 217	4,27
			11 903 663	11 951 730	13,74
États-Unis					
Avantor Funding Inc. 2.625% 20 - 01.11.25	860 000	EUR	843 247	840 650	0,97
BAT Capital Corp. 2.125% 17 - 15.08.25	296 000	GBP	326 301	324 578	0,37
Goldman Sachs Group Inc. 3.375% 20 - 27.03.25	100 000	EUR	99 270	99 799	0,11
Kellanova 1.25% 15 - 10.03.25	997 000	EUR	971 934	971 806	1,12
Liberty Mutual Group Inc. 2.75% 16 - 04.05.26	631 000	EUR	609 684	620 936	0,71
Philip Morris International Inc. 2.875% 12 - 30.05.24	680 000	EUR	678 200	676 763	0,78
PVH Corp. 3.625% 16 - 15.07.24	3 699 000	EUR	3 694 735	3 687 348	4,24
			7 223 371	7 221 880	8,30
Total - Obligations			84 129 829	84 553 312	97,24
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			84 129 829	84 553 312	97,24
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			84 129 829	84 553 312	97,24
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				85 660 690	98,51

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Chine					
Agricultural Development Bank of China 2.60% 22 - 01.12.25	1 000 000	CNY	144 922	141 724	0,47
Agricultural Development Bank of China 2.63% 23 - 07.06.28	1 000 000	CNY	139 961	141 716	0,47
Agricultural Development Bank of China 2.83% 22 - 11.08.29	1 500 000	CNY	213 688	214 011	0,71
Agricultural Development Bank of China 2.90% 23 - 08.03.28	1 000 000	CNY	139 233	143 021	0,47
Agricultural Development Bank of China 2.91% 22 - 21.02.29	500 000	CNY	70 659	71 455	0,24
Agricultural Development Bank of China 2.96% 20 - 17.04.30	1 000 000	CNY	145 252	143 435	0,47
Agricultural Development Bank of China 2.97% 22 - 14.10.32	1 000 000	CNY	143 057	143 356	0,47
Agricultural Development Bank of China 3.06% 22 - 06.06.32	1 000 000	CNY	139 448	144 154	0,48
Agricultural Development Bank of China 3.10% 23 - 27.02.33	1 000 000	CNY	139 932	144 853	0,48
Agricultural Development Bank of China 3.30% 21 - 05.11.31	1 000 000	CNY	150 860	146 501	0,48
Agricultural Development Bank of China 3.45% 20 - 23.09.25	1 000 000	CNY	154 911	143 592	0,47
Agricultural Development Bank of China 3.52% 21 - 24.05.31	1 000 000	CNY	156 537	148 509	0,49
Agricultural Development Bank of China 3.58% 16 - 22.04.26	2 000 000	CNY	312 391	289 656	0,96
Agricultural Development Bank of China 3.85% 17 - 06.01.27	2 000 000	CNY	315 458	293 619	0,97
Agricultural Development Bank of China 4.98% 18 - 12.01.25	1 000 000	CNY	158 624	144 819	0,48
China 2.00% 23 - 15.06.25	4 000 000	CNY	552 679	562 253	1,86
China 2.18% 22 - 25.08.25	2 000 000	CNY	289 911	281 886	0,93
China 2.18% 23 - 15.08.26	4 000 000	CNY	544 400	562 407	1,86
China 2.22% 23 - 25.09.25	4 000 000	CNY	548 948	564 117	1,86
China 2.24% 22 - 25.05.25	2 000 000	CNY	281 554	282 162	0,93
China 2.26% 22 - 24.02.25	4 000 000	CNY	559 221	564 520	1,86
China 2.28% 22 - 25.11.25	4 000 000	CNY	585 632	564 500	1,86
China 2.30% 23 - 15.05.26	4 500 000	CNY	621 366	634 940	2,10
China 2.35% 23 - 15.03.25	5 000 000	CNY	703 975	706 483	2,33
China 2.37% 22 - 20.01.27	3 000 000	CNY	469 266	423 407	1,40
China 2.37% 22 - 20.01.27	1 000 000	CNY	147 840	141 136	0,47
China 2.40% 23 - 15.07.28	2 000 000	CNY	272 559	281 969	0,93
China 2.44% 22 - 15.10.27	4 000 000	CNY	579 827	564 916	1,86
China 2.46% 23 - 15.02.26	5 000 000	CNY	724 413	707 768	2,34
China 2.48% 22 - 15.04.27	4 000 000	CNY	593 274	565 937	1,87
China 2.48% 23 - 25.09.28	1 000 000	CNY	136 681	141 425	0,47
China 2.50% 22 - 25.07.27	5 000 000	CNY	721 779	707 992	2,34
China 2.52% 23 - 25.08.33	3 000 000	CNY	408 298	421 047	1,39

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
China 2.55% 23 - 15.10.28	2 000 000	CNY	276 714	283 960	0,94
China 2.60% 22 - 01.09.32	3 000 000	CNY	431 665	422 969	1,40
China 2.60% 23 - 15.09.30	2 000 000	CNY	279 400	283 240	0,93
China 2.62% 22 - 25.09.29	2 000 000	CNY	288 053	283 820	0,94
China 2.62% 23 - 15.04.28	2 000 000	CNY	279 279	284 725	0,94
China 2.62% 23 - 25.06.30	1 000 000	CNY	136 196	141 734	0,47
China 2.64% 23 - 15.01.28	2 000 000	CNY	282 702	284 937	0,94
China 2.67% 23 - 25.05.33	3 000 000	CNY	416 102	425 774	1,41
China 2.68% 20 - 21.05.30	1 000 000	CNY	138 014	142 207	0,47
China 2.69% 21 - 12.08.26	5 000 000	CNY	791 386	711 856	2,35
China 2.69% 22 - 15.08.32	3 000 000	CNY	417 772	425 911	1,41
China 2.75% 22 - 17.02.32	3 000 000	CNY	426 799	428 128	1,41
China 2.75% 22 - 15.06.29	4 000 000	CNY	587 159	571 730	1,89
China 2.76% 22 - 15.05.32	3 000 000	CNY	414 374	428 156	1,41
China 2.79% 22 - 15.12.29	4 000 000	CNY	576 612	573 154	1,89
China 2.80% 22 - 24.03.29	2 000 000	CNY	304 821	286 485	0,95
China 2.80% 22 - 15.11.32	3 000 000	CNY	438 984	429 872	1,42
China 2.80% 23 - 25.03.30	2 000 000	CNY	290 996	286 281	0,94
China 2.85% 20 - 04.06.27	4 000 000	CNY	588 753	572 842	1,89
China 2.88% 23 - 25.02.33	2 000 000	CNY	290 716	289 142	0,95
China 2.89% 21 - 18.11.31	3 000 000	CNY	440 457	432 589	1,43
China 2.91% 21 - 14.10.28	3 000 000	CNY	412 745	432 931	1,43
China 3.01% 21 - 13.05.28	4 000 000	CNY	622 468	578 923	1,91
China 3.02% 20 - 22.10.25	3 000 000	CNY	462 350	429 440	1,42
China 3.02% 21 - 27.05.31	6 000 000	CNY	937 901	873 606	2,88
China 3.03% 21 - 11.03.26	5 000 000	CNY	787 877	717 471	2,37
China 3.13% 19 - 21.11.29	4 000 000	CNY	619 359	584 647	1,93
China 3.25% 18 - 22.11.28	1 000 000	CNY	146 384	146 769	0,48
China 3.25% 19 - 06.06.26	2 000 000	CNY	300 269	289 147	0,95
China 3.27% 20 - 19.11.30	2 000 000	CNY	316 489	295 835	0,98
China 3.28% 20 - 03.12.27	2 000 000	CNY	289 810	292 557	0,97
China 3.54% 18 - 16.08.28	1 000 000	CNY	159 200	148 971	0,49
China 3.77% 18 - 08.03.25	3 000 000	CNY	482 609	432 493	1,43
China Development Bank 2.52% 23 - 25.05.28	1 000 000	CNY	137 632	141 258	0,47
China Development Bank 2.65% 22 - 24.02.27	1 000 000	CNY	138 310	142 045	0,47
China Development Bank 2.69% 22 - 16.06.27	1 000 000	CNY	146 333	142 158	0,47
China Development Bank 2.73% 23 - 11.01.28	1 000 000	CNY	144 657	142 359	0,47
China Development Bank 2.82% 23 - 22.05.33	1 000 000	CNY	137 481	142 250	0,47
China Development Bank 2.87% 23 - 09.01.30	1 000 000	CNY	140 866	142 881	0,47
China Development Bank 2.98% 22 - 22.04.32	1 000 000	CNY	148 078	143 410	0,47
China Development Bank 2.99% 22 - 01.03.29	2 000 000	CNY	291 546	287 703	0,95
China Development Bank 3.00% 22 - 17.01.32	1 000 000	CNY	146 623	143 588	0,47
China Development Bank 3.02% 23 - 06.03.33	1 000 000	CNY	142 014	144 068	0,48
China Development Bank 3.18% 16 - 05.04.26	3 000 000	CNY	458 944	430 809	1,42
China Development Bank 3.34% 20 - 14.07.25	2 000 000	CNY	309 786	286 299	0,94
China Development Bank 3.41% 21 - 07.06.31	1 000 000	CNY	158 506	147 604	0,49
China Development Bank 3.66% 21 - 01.03.31	1 000 000	CNY	158 273	149 790	0,49
Export-Import Bank of China 2.87% 23 - 06.02.28	2 000 000	CNY	276 946	285 908	0,94

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Export-Import Bank of China 2.90% 22 - 19.08.32	2 000 000	CNY	284 824	285 394	0,94
Export-Import Bank of China 2.93% 20 - 02.03.25	4 000 000	CNY	614 568	568 037	1,87
Export-Import Bank of China 3.10% 23 - 13.02.33	1 000 000	CNY	145 529	144 846	0,48
Export-Import Bank of China 3.18% 22 - 11.03.32	1 000 000	CNY	149 193	145 234	0,48
Export-Import Bank of China 3.22% 21 - 14.05.26	1 000 000	CNY	155 422	143 722	0,47
Export-Import Bank of China 3.26% 20 - 24.02.27	2 000 000	CNY	307 576	288 981	0,95
Export-Import Bank of China 3.33% 16 - 22.02.26	2 000 000	CNY	315 509	287 589	0,95
Export-Import Bank of China 3.38% 21 - 16.07.31	2 000 000	CNY	313 384	294 588	0,97
Export-Import Bank of China 3.74% 20 - 16.11.30	1 000 000	CNY	159 028	150 267	0,50
Export-Import Bank of China 3.86% 19 - 20.05.29	1 000 000	CNY	151 872	149 640	0,49
			30 433 871	29 676 016	97,96
Total - Obligations			30 433 871	29 676 016	97,96
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			30 433 871	29 676 016	97,96
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			30 433 871	29 676 016	97,96
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				30 099 440	99,36

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Aurizon Network Pty Ltd. 2.00% 14 - 18.09.24	500 000	EUR	491 429	492 580	0,05
Aurizon Network Pty Ltd. 3.125% 16 - 01.06.26	600 000	EUR	591 154	594 420	0,06
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 21 - 05.05.31	590 000	EUR	524 914	540 593	0,05
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0.75% 16 - 29.09.26	600 000	EUR	557 570	563 178	0,05
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 19 - 21.11.29	630 000	EUR	598 600	608 372	0,06
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3.652% 23 - 20.01.26	600 000	EUR	601 291	604 464	0,06
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. FRN 23 - 03.02.33	700 000	EUR	692 105	719 411	0,07
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd. 1.75% 14 - 15.10.24	200 000	EUR	193 678	196 256	0,02
Brambles Finance Ltd. 2.375% 14 - 12.06.24	500 000	EUR	500 769	496 250	0,05
Commonwealth Bank of Australia 1.125% 18 - 18.01.28	400 000	EUR	370 034	375 172	0,03
Commonwealth Bank of Australia FRN 17 - 03.10.29	600 000	EUR	578 745	585 036	0,05
Goodman Australia Finance Pty Ltd. 1.375% 17 - 27.09.25	400 000	EUR	385 498	386 616	0,04
National Australia Bank Ltd. 0.25% 19 - 20.05.24	600 000	EUR	587 368	591 492	0,06
National Australia Bank Ltd. 0.625% 17 - 18.09.24	300 000	EUR	291 852	293 148	0,03
National Australia Bank Ltd. 1.25% 16 - 18.05.26	500 000	EUR	482 467	482 360	0,05
National Australia Bank Ltd. 1.375% 18 - 30.08.28	700 000	EUR	633 741	647 192	0,06
National Australia Bank Ltd. 2.125% 22 - 24.05.28	800 000	EUR	756 084	772 504	0,07
Scentre Group Trust 1 2.25% 14 - 16.07.24	400 000	EUR	396 752	394 836	0,04
Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 1.75% 18 - 11.04.28	400 000	EUR	360 614	364 528	0,03
Stockland Trust 1.625% 18 - 27.04.26	100 000	EUR	93 129	94 963	0,01
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 18 - 26.04.28	500 000	EUR	459 580	470 390	0,04
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 2.75% 14 - 23.04.24	600 000	EUR	597 795	597 294	0,06
Telstra Corp. Ltd. 1.125% 16 - 14.04.26	700 000	EUR	666 571	671 076	0,06
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.75% 17 - 29.03.28	600 000	EUR	555 192	565 248	0,05
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.875% 14 - 16.09.24	600 000	EUR	599 297	590 982	0,06
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 2.00% 15 - 28.08.25	420 000	EUR	414 531	410 353	0,04
Westpac Banking Corp. 0.625% 17 - 22.11.24	300 000	EUR	290 980	291 432	0,03
Westpac Banking Corp. FRN 21 - 13.05.31	800 000	EUR	712 299	733 312	0,07
Westpac Banking Corp. 0.875% 16 - 17.04.27	400 000	EUR	370 809	371 180	0,03
Westpac Banking Corp. 1.125% 17 - 05.09.27	500 000	EUR	451 940	464 935	0,04
Westpac Banking Corp. 1.45% 18 - 17.07.28	400 000	EUR	363 339	372 972	0,03
Westpac Banking Corp. 3.703% 23 - 16.01.26	700 000	EUR	700 572	706 139	0,07
Woolworths Group Ltd. 0.375% 21 - 15.11.28	400 000	EUR	336 176	343 896	0,03
			16 206 875	16 392 580	1,55
Autriche					
A1 Towers Holding GmbH 5.25% 23 - 13.07.28	500 000	EUR	513 988	529 175	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0.375% 19 - 03.09.27	200 000	EUR	165 489	179 924	0,02
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 4.125% 23 - 18.01.27	300 000	EUR	302 376	304 233	0,03
CA Immobilien Anlagen AG 0.875% 20 - 05.02.27	400 000	EUR	347 775	355 984	0,03
CA Immobilien Anlagen AG 1.00% 20 - 27.10.25	400 000	EUR	360 436	365 972	0,03
Erste Group Bank AG 0.05% 20 - 16.09.25	200 000	EUR	187 868	189 040	0,02
Erste Group Bank AG FRN 20 - 16.11.28	500 000	EUR	423 033	441 435	0,04
Erste Group Bank AG 0.125% 21 - 17.05.28	300 000	EUR	256 444	263 196	0,02
Erste Group Bank AG 0.375% 19 - 16.04.24	300 000	EUR	292 625	296 763	0,03
Erste Group Bank AG 0.875% 19 - 22.05.26	300 000	EUR	277 629	284 184	0,03
Erste Group Bank AG 0.875% 20 - 13.05.27	400 000	EUR	360 188	370 788	0,03
Erste Group Bank AG FRN 21 - 15.11.32	300 000	EUR	242 901	262 194	0,02
Erste Group Bank AG FRN 19 - 10.06.30	400 000	EUR	373 336	377 356	0,04
Erste Group Bank AG 1.50% 22 - 07.04.26	300 000	EUR	283 171	288 696	0,03
Erste Group Bank AG FRN 20 - 08.09.31	500 000	EUR	461 695	466 530	0,04
Erste Group Bank AG FRN 22 - 07.06.33	300 000	EUR	279 678	294 996	0,03
Mondi Finance Europe GmbH 2.375% 20 - 01.04.28	600 000	EUR	568 618	587 904	0,06
Raiffeisen Bank International AG 0.05% 21 - 01.09.27	200 000	EUR	162 526	174 368	0,02
Raiffeisen Bank International AG 0.25% 20 - 22.01.25	400 000	EUR	381 511	384 652	0,04
Raiffeisen Bank International AG 0.375% 19 - 25.09.26	500 000	EUR	439 878	457 210	0,04
Raiffeisen Bank International AG FRN 21 - 17.06.33	300 000	EUR	227 322	245 289	0,02
Raiffeisen Bank International AG FRN 19 - 12.03.30	600 000	EUR	535 765	559 230	0,05
Raiffeisen Bank International AG FRN 20 - 18.06.32	200 000	EUR	163 428	179 218	0,02
Raiffeisen Bank International AG 4.125% 22 - 08.09.25	400 000	EUR	396 272	402 236	0,04
Raiffeisen Bank International AG FRN 23 - 26.01.27	600 000	EUR	599 150	606 654	0,06
Raiffeisen Bank International AG 5.75% 22 - 27.01.28	300 000	EUR	316 314	320 991	0,03
Raiffeisen Bank International AG FRN 23 - 15.09.28	400 000	EUR	399 647	417 304	0,04
Raiffeisen Bank International AG FRN 22 - 20.12.32	200 000	EUR	200 790	210 484	0,02
Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 16 - 07.12.26	700 000	EUR	671 760	674 345	0,06
UNIQA Insurance Group AG FRN 15 - 27.07.46	200 000	EUR	206 478	205 116	0,02
Wienerberger AG 2.75% 20 - 04.06.25	500 000	EUR	488 712	491 225	0,05
Wienerberger AG 4.875% 23 - 04.10.28	400 000	EUR	402 586	424 004	0,04
			11 289 389	11 610 696	1,10
Belgique					
AG Insurance SA FRN 15 - 30.06.47	200 000	EUR	182 668	191 960	0,02
Barry Callebaut Services NV 2.375% 16 - 24.05.24	400 000	EUR	400 918	397 036	0,04
Cofinimmo SA 1.00% 22 - 24.01.28	300 000	EUR	255 305	271 644	0,02
Elia Group SA 1.50% 18 - 05.09.28	200 000	EUR	178 065	185 964	0,02
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 15 - 27.05.24	400 000	EUR	396 515	395 800	0,04
Elia Transmission Belgium SA 1.375% 19 - 14.01.26	600 000	EUR	580 126	576 858	0,05
Elia Transmission Belgium SA 3.25% 13 - 04.04.28	600 000	EUR	599 986	605 442	0,06
Groupe Bruxelles Lambert NV 1.375% 17 - 23.05.24	500 000	EUR	495 683	494 930	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Groupe Bruxelles Lambert NV 1.875% 18 - 19.06.25	500 000	EUR	493 790	488 885	0,05
KBC Group NV FRN 20 - 10.09.26	500 000	EUR	464 237	471 485	0,04
KBC Group NV FRN 21 - 14.01.29	300 000	EUR	250 176	262 515	0,02
KBC Group NV FRN 21 - 01.03.27	800 000	EUR	740 440	748 208	0,07
KBC Group NV FRN 20 - 16.06.27	400 000	EUR	369 195	372 600	0,03
KBC Group NV FRN 19 - 03.12.29	700 000	EUR	655 695	670 530	0,06
KBC Group NV FRN 21 - 07.12.31	500 000	EUR	430 261	451 250	0,04
KBC Group NV FRN 22 - 21.01.28	500 000	EUR	452 156	460 080	0,04
KBC Group NV FRN 22 - 29.03.26	400 000	EUR	386 917	389 124	0,04
KBC Group NV FRN 17 - 18.09.29	300 000	EUR	290 750	292 380	0,03
KBC Group NV FRN 22 - 29.06.25	300 000	EUR	296 808	297 942	0,03
KBC Group NV FRN 23 - 28.11.29	400 000	EUR	402 814	410 984	0,04
KBC Group NV FRN 22 - 23.11.27	600 000	EUR	606 576	614 094	0,06
KBC Group NV FRN 23 - 06.06.26	800 000	EUR	800 884	808 664	0,08
KBC Group NV FRN 23 - 25.04.33	300 000	EUR	295 735	306 654	0,03
Lonza Finance International NV 1.625% 20 - 21.04.27	200 000	EUR	188 660	191 680	0,02
Lonza Finance International NV 1.625% 20 - 21.04.27	300 000	EUR	283 130	287 520	0,03
Solvay SA 2.75% 15 - 02.12.27	600 000	EUR	582 055	588 672	0,06
Syensqo SA FRN 20 - 31.12.99	500 000	EUR	476 335	474 445	0,04
VGP NV 1.625% 22 - 17.01.27	400 000	EUR	319 468	350 316	0,03
			11 875 348	12 057 662	1,14
Bermudes					
Aegon NV FRN 14 - 25.04.44	400 000	EUR	399 821	397 380	0,04
			399 821	397 380	0,04
Canada					
Bank of Montreal 2.75% 22 - 15.06.27	600 000	EUR	581 489	590 178	0,05
Bank of Nova Scotia 0.125% 19 - 04.09.26	500 000	EUR	457 187	461 625	0,04
Bank of Nova Scotia 0.25% 21 - 01.11.28	400 000	EUR	338 810	347 212	0,03
Bank of Nova Scotia 0.50% 19 - 30.04.24	600 000	EUR	585 653	593 130	0,06
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.375% 19 - 03.05.24	500 000	EUR	487 331	493 890	0,05
Great-West Lifeco Inc. 1.75% 16 - 07.12.26	400 000	EUR	381 380	388 336	0,04
Magna International Inc. 1.50% 17 - 25.09.27	600 000	EUR	544 615	572 298	0,05
National Bank of Canada 3.75% 23 - 25.01.28	400 000	EUR	396 809	404 836	0,04
Royal Bank of Canada 0.125% 19 - 23.07.24	500 000	EUR	480 628	489 495	0,05
Royal Bank of Canada 0.25% 19 - 02.05.24	400 000	EUR	392 633	395 112	0,04
Royal Bank of Canada 4.125% 23 - 05.07.28	400 000	EUR	404 461	412 732	0,04
Toronto-Dominion Bank 0.375% 19 - 25.04.24	1 100 000	EUR	1 071 150	1 087 669	0,10
Toronto-Dominion Bank 0.50% 22 - 18.01.27	430 000	EUR	391 207	398 107	0,04
Toronto-Dominion Bank 2.551% 22 - 03.08.27	560 000	EUR	532 447	547 898	0,05
			7 045 800	7 182 518	0,68
Croatie					
Erste & Steiermaerkische Bank FRN 21 - 06.07.28	200 000	EUR	172 892	171 914	0,02
Raiffeisenbank Austria dd FRN 23 - 05.06.27	200 000	EUR	204 345	211 244	0,02
			377 237	383 158	0,04
République tchèque					
Ceska sporitelna AS FRN 21 - 13.09.28	300 000	EUR	236 882	259 413	0,02
Ceska sporitelna AS FRN 23 - 08.03.28	300 000	EUR	302 221	309 693	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Ceska sporitelna AS FRN 23 - 29.06.27	300 000	EUR	300 891	311 181	0,03
Ceska Sporitelna AS FRN 22 - 14.11.25	500 000	EUR	510 659	509 530	0,05
Raiffeisenbank AS FRN 21 - 09.06.28	200 000	EUR	156 686	172 088	0,02
Raiffeisenbank AS FRN 23 - 19.01.26	400 000	EUR	403 699	404 308	0,04
			1 911 038	1 966 213	0,19
Danemark					
AP Moller - Maersk A/S 1.75% 18 - 16.03.26	700 000	EUR	682 779	677 453	0,06
Danica Pension Livsforsikrings AB FRN 15 - 29.09.45	300 000	EUR	294 994	296 280	0,03
Danske Bank A/S FRN 19 - 27.08.25	600 000	EUR	570 745	586 704	0,06
Danske Bank A/S 0.625% 20 - 26.05.25	600 000	EUR	575 148	576 780	0,05
Danske Bank A/S FRN 21 - 09.06.29	300 000	EUR	253 949	265 578	0,02
Danske Bank A/S FRN 21 - 15.05.31	500 000	EUR	445 895	466 540	0,04
Danske Bank A/S FRN 19 - 12.02.30	400 000	EUR	375 107	385 652	0,04
Danske Bank A/S FRN 22 - 17.02.27	400 000	EUR	369 423	381 176	0,04
Danske Bank A/S FRN 20 - 02.09.30	400 000	EUR	376 253	381 516	0,04
Danske Bank A/S 1.625% 19 - 15.03.24	250 000	EUR	247 860	248 770	0,02
Danske Bank A/S FRN 19 - 21.06.29	600 000	EUR	587 744	593 604	0,06
Danske Bank A/S FRN 23 - 12.01.27	700 000	EUR	700 403	705 530	0,07
Danske Bank A/S FRN 23 - 09.11.28	300 000	EUR	303 813	309 570	0,03
DSV A/S 0.375% 20 - 26.02.27	560 000	EUR	507 907	515 900	0,05
H Lundbeck A/S 0.875% 20 - 14.10.27	620 000	EUR	550 457	561 639	0,05
ISS Global A/S 0.875% 19 - 18.06.26	500 000	EUR	463 784	468 780	0,04
ISS Global A/S 1.50% 17 - 31.08.27	500 000	EUR	446 159	466 790	0,04
ISS Global A/S 2.125% 14 - 02.12.24	200 000	EUR	199 948	196 134	0,02
Jyske Bank A/S FRN 21 - 02.09.26	400 000	EUR	372 114	375 652	0,04
Jyske Bank A/S FRN 21 - 17.02.28	200 000	EUR	179 608	181 532	0,02
Jyske Bank A/S FRN 20 - 15.10.25	300 000	EUR	285 809	291 729	0,03
Jyske Bank A/S FRN 17 - 05.04.29	200 000	EUR	196 701	197 988	0,02
Jyske Bank A/S FRN 22 - 11.04.26	370 000	EUR	369 008	373 330	0,03
Jyske Bank A/S FRN 23 - 10.11.29	400 000	EUR	408 716	416 236	0,04
Jyske Bank A/S FRN 23 - 26.10.28	300 000	EUR	300 823	311 928	0,03
Jyske Bank A/S 5.50% 22 - 16.11.27	300 000	EUR	306 567	314 691	0,03
Nykredit Realkredit AS 0.125% 19 - 10.07.24	300 000	EUR	286 097	294 117	0,03
Nykredit Realkredit AS 0.25% 20 - 13.01.26	500 000	EUR	460 632	469 495	0,04
Nykredit Realkredit AS 0.375% 21 - 17.01.28	300 000	EUR	252 629	264 201	0,02
Nykredit Realkredit AS 0.50% 20 - 10.07.25	500 000	EUR	475 280	478 010	0,04
Nykredit Realkredit AS 0.625% 19 - 17.01.25	400 000	EUR	384 522	387 800	0,04
Nykredit Realkredit AS 0.75% 20 - 20.01.27	400 000	EUR	363 781	368 036	0,03
Nykredit Realkredit AS FRN 21 - 28.07.31	200 000	EUR	178 290	182 444	0,02
Nykredit Realkredit AS 1.375% 22 - 12.07.27	500 000	EUR	457 050	467 965	0,04
Nykredit Realkredit AS 4.00% 23 - 17.07.28	600 000	EUR	592 279	607 596	0,06
Nykredit Realkredit AS FRN 22 - 29.12.32	200 000	EUR	198 681	206 362	0,02
Pandora A/S 4.50% 23 - 10.04.28	400 000	EUR	403 794	415 140	0,04
Sydbank AS FRN 21 - 10.11.26	400 000	EUR	365 591	375 168	0,04
Sydbank AS FRN 22 - 30.09.25	300 000	EUR	300 289	300 930	0,03
Sydbank AS FRN 23 - 06.09.28	400 000	EUR	401 158	413 196	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Danemark (suite)					
TDC Net A/S 5.056% 22 - 31.05.28	600 000	EUR	589 950	623 532	0,06
Vestas Wind Systems A/S 4.125% 23 - 15.06.26	600 000	EUR	604 682	610 002	0,06
			16 686 419	17 011 476	1,61
Estonie					
Luminor Bank AS FRN 21 - 23.09.26	200 000	EUR	179 484	183 630	0,02
Luminor Bank AS FRN 23 - 16.01.26	300 000	EUR	304 709	305 550	0,03
Luminor Bank AS FRN 23 - 08.06.27	100 000	EUR	101 689	105 397	0,01
			585 882	594 577	0,06
Finlande					
Castellum Helsinki Finance Holdings Abp 2.00% 22 - 24.03.25	400 000	EUR	374 434	386 004	0,04
Elisa OYJ 0.25% 20 - 15.09.27	200 000	EUR	174 248	181 206	0,02
Elisa OYJ 1.125% 19 - 26.02.26	350 000	EUR	335 676	335 608	0,03
Kojamo OYJ 1.50% 17 - 19.06.24	300 000	EUR	292 329	294 201	0,03
Kojamo OYJ 1.625% 18 - 07.03.25	600 000	EUR	570 165	574 446	0,05
Kojamo OYJ 1.875% 20 - 27.05.27	300 000	EUR	261 223	268 182	0,02
Kojamo OYJ 2.00% 22 - 31.03.26	100 000	EUR	94 276	93 369	0,01
Metso Outotec OYJ 0.875% 20 - 26.05.28	300 000	EUR	261 715	268 539	0,02
Metso Outotec OYJ 4.875% 22 - 07.12.27	300 000	EUR	307 457	314 823	0,03
Nokia OYJ 2.00% 17 - 15.03.24	600 000	EUR	597 595	596 928	0,06
Nokia OYJ 2.00% 19 - 11.03.26	700 000	EUR	670 323	674 331	0,06
Nokia OYJ 3.125% 20 - 15.05.28	400 000	EUR	383 706	391 040	0,04
Nordea Bank Abp 0.375% 19 - 28.05.26	400 000	EUR	373 222	375 792	0,04
Nordea Bank Abp 0.50% 20 - 14.05.27	700 000	EUR	630 656	646 240	0,06
Nordea Bank Abp 0.50% 21 - 02.11.28	700 000	EUR	601 789	614 866	0,06
Nordea Bank Abp FRN 19 - 27.06.29	200 000	EUR	194 192	195 852	0,02
Nordea Bank Abp 1.125% 15 - 12.02.25	800 000	EUR	782 106	779 704	0,07
Nordea Bank Abp 1.125% 17 - 27.09.27	410 000	EUR	369 499	387 061	0,04
Nordea Bank Abp 1.125% 22 - 16.02.27	630 000	EUR	590 520	591 803	0,06
Nordea Bank Abp FRN 23 - 10.02.26	600 000	EUR	596 058	598 446	0,06
Nordea Bank Abp 4.125% 23 - 05.05.28	600 000	EUR	603 551	619 410	0,06
Nordea Bank Abp FRN 23 - 06.09.26	700 000	EUR	702 215	708 862	0,07
OP Corporate Bank PLC 0.10% 20 - 16.11.27	650 000	EUR	561 643	578 831	0,05
OP Corporate Bank PLC 0.125% 20 - 01.07.24	500 000	EUR	484 078	490 490	0,05
OP Corporate Bank PLC 0.25% 21 - 24.03.26	400 000	EUR	379 954	373 568	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.375% 19 - 26.02.24	200 000	EUR	194 957	198 908	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.375% 19 - 19.06.24	300 000	EUR	297 229	294 924	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.375% 21 - 16.06.28	400 000	EUR	341 186	352 612	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.375% 21 - 08.12.28	400 000	EUR	347 316	345 800	0,03
OP Corporate Bank PLC 0.50% 20 - 12.08.25	600 000	EUR	567 876	573 108	0,05
OP Corporate Bank PLC 0.60% 20 - 18.01.27	200 000	EUR	179 724	183 498	0,02
OP Corporate Bank PLC 0.625% 22 - 27.07.27	340 000	EUR	298 888	308 781	0,03
OP Corporate Bank PLC 1.00% 18 - 22.05.25	300 000	EUR	290 930	289 968	0,03
OP Corporate Bank PLC FRN 20 - 09.06.30	500 000	EUR	468 345	477 840	0,04
OP Corporate Bank PLC 2.875% 22 - 15.12.25	800 000	EUR	781 387	795 992	0,07
OP Corporate Bank PLC 4.00% 23 - 13.06.28	500 000	EUR	502 334	516 615	0,05
OP Corporate Bank PLC 4.125% 22 - 18.04.27	370 000	EUR	375 196	380 608	0,04
Sampo OYJ 1.625% 18 - 21.02.28	300 000	EUR	286 595	289 800	0,03

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Stora Enso OYJ 2.50% 17 - 07.06.27	400 000	EUR	386 448	391 044	0,04
Stora Enso OYJ 2.50% 18 - 21.03.28	350 000	EUR	333 887	336 585	0,03
Stora Enso OYJ 4.00% 23 - 01.06.26	500 000	EUR	502 038	505 735	0,05
			17 346 966	17 581 420	1,67
France					
Accor SA 2.375% 21 - 29.11.28	500 000	EUR	464 913	476 605	0,04
Accor SA 3.00% 19 - 04.02.26	800 000	EUR	764 827	769 216	0,07
Air Liquide Finance SA 0.75% 16 - 13.06.24	200 000	EUR	197 146	197 496	0,02
Air Liquide Finance SA 1.00% 17 - 08.03.27	700 000	EUR	658 338	666 547	0,06
Air Liquide Finance SA 1.00% 20 - 02.04.25	500 000	EUR	485 675	486 250	0,05
Air Liquide Finance SA 1.25% 15 - 03.06.25	500 000	EUR	490 683	487 590	0,05
Air Liquide Finance SA 1.25% 16 - 13.06.28	1 000 000	EUR	924 710	952 140	0,09
Air Liquide Finance SA 1.875% 14 - 05.06.24	500 000	EUR	498 855	495 630	0,05
ALD SA Zero Coupon 21 - 23.02.24	300 000	EUR	288 323	298 248	0,03
ALD SA 1.25% 22 - 02.03.26	500 000	EUR	465 030	477 115	0,04
ALD SA 4.00% 22 - 05.07.27	100 000	EUR	101 421	102 189	0,01
ALD SA 4.25% 23 - 18.01.27	400 000	EUR	406 820	408 932	0,04
ALD SA 4.375% 23 - 23.11.26	400 000	EUR	405 130	409 760	0,04
ALD SA 4.75% 22 - 13.10.25	600 000	EUR	603 040	611 682	0,06
ALD SA 4.875% 23 - 06.10.28	700 000	EUR	716 672	741 055	0,07
Alstom SA 0.125% 21 - 27.07.27	600 000	EUR	521 141	526 452	0,05
Alstom SA 0.25% 19 - 14.10.26	500 000	EUR	456 049	452 930	0,04
Altarea SCA 1.875% 19 - 17.01.28	300 000	EUR	252 027	251 721	0,02
APRR SA Zero Coupon 21 - 19.06.28	300 000	EUR	256 325	265 275	0,02
APRR SA 1.125% 16 - 09.01.26	700 000	EUR	680 625	675 458	0,06
APRR SA 1.25% 16 - 06.01.27	500 000	EUR	472 952	476 930	0,04
APRR SA 1.25% 19 - 18.01.28	600 000	EUR	548 693	564 144	0,05
APRR SA 1.25% 20 - 14.01.27	500 000	EUR	470 871	476 280	0,04
APRR SA 1.875% 14 - 15.01.25	700 000	EUR	693 518	687 106	0,06
Arkema SA 0.125% 20 - 14.10.26	400 000	EUR	363 462	369 916	0,03
Arkema SA 1.50% 15 - 20.01.25	700 000	EUR	685 704	684 915	0,06
Arkema SA 1.50% 17 - 20.04.27	1 000 000	EUR	938 073	952 590	0,09
Arkema SA FRN 20 - 31.12.99	200 000	EUR	177 413	185 000	0,02
Arkema SA FRN 19 - 31.12.99	200 000	EUR	194 449	197 546	0,02
Arval Service Lease SA Zero Coupon 21 - 30.09.24	400 000	EUR	383 266	387 668	0,04
Arval Service Lease SA Zero Coupon 21 - 01.10.25	300 000	EUR	276 277	282 126	0,03
Arval Service Lease SA 0.875% 22 - 17.02.25	400 000	EUR	381 264	386 708	0,04
Arval Service Lease SA 3.375% 22 - 04.01.26	400 000	EUR	394 886	399 588	0,04
Arval Service Lease SA 4.00% 22 - 22.09.26	500 000	EUR	495 477	506 405	0,05
Arval Service Lease SA 4.125% 23 - 13.04.26	500 000	EUR	501 693	505 910	0,05
Arval Service Lease SA 4.25% 23 - 11.11.25	500 000	EUR	500 180	505 670	0,05
Arval Service Lease SA 4.625% 23 - 02.12.24	300 000	EUR	300 727	301 440	0,03
Arval Service Lease SA 4.75% 22 - 22.05.27	300 000	EUR	308 394	311 271	0,03
Autoroutes du Sud de la France SA 1.00% 16 - 13.05.26	700 000	EUR	666 333	668 773	0,06
Autoroutes du Sud de la France SA 1.125% 17 - 20.04.26	500 000	EUR	478 431	479 820	0,05

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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	1 000 000	EUR	959 455	954 150	0,09
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 18 - 27.06.28	800 000	EUR	739 072	754 040	0,07
AXA SA 1.125% 16 - 15.05.28	200 000	EUR	185 531	187 736	0,02
AXA SA FRN 16 - 06.07.47	900 000	EUR	866 247	881 100	0,08
AXA SA FRN 14 - 20.05.49	700 000	EUR	688 827	690 697	0,07
AXA SA FRN 14 - 29.11.49	600 000	EUR	602 768	593 394	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 21 - 11.05.26	1 200 000	EUR	1 092 991	1 115 016	0,11
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 21 - 07.03.25	800 000	EUR	756 420	766 504	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 21 - 07.03.25	100 000	EUR	95 534	95 813	0,01
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.10% 20 - 08.10.27	500 000	EUR	432 382	447 855	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 19 - 05.02.24	1 000 000	EUR	983 496	996 410	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 21 - 19.07.28	700 000	EUR	591 143	605 948	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 21 - 29.06.28	600 000	EUR	513 395	528 474	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 21 - 03.11.28	900 000	EUR	774 833	787 230	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 22 - 19.11.27	500 000	EUR	434 187	449 900	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 18 - 17.07.25	900 000	EUR	862 453	863 217	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 19 - 08.06.26	1 200 000	EUR	1 132 436	1 129 368	0,11
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.00% 22 - 23.05.25	1 000 000	EUR	960 904	966 330	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 15 - 14.01.25	900 000	EUR	885 024	877 221	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 17 - 26.05.27	700 000	EUR	644 076	656 579	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.375% 18 - 16.07.28	500 000	EUR	448 130	464 495	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 16 - 19.01.26	700 000	EUR	685 620	676 690	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.625% 17 - 15.11.27	400 000	EUR	359 313	371 564	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 16 - 04.11.26	400 000	EUR	380 235	382 860	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.375% 16 - 24.03.26	700 000	EUR	683 195	684 495	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.50% 18 - 25.05.28	200 000	EUR	183 908	191 878	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.625% 14 - 18.03.24	900 000	EUR	913 584	897 282	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 17 - 31.03.27	200 000	EUR	194 251	194 320	0,02
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 14 - 21.05.24	600 000	EUR	607 876	597 252	0,06
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.00% 15 - 11.09.25	700 000	EUR	699 568	694 806	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.125% 22 - 14.09.27	1 100 000	EUR	1 073 832	1 096 271	0,10
Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 22 - 16.06.32	700 000	EUR	664 472	691 411	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.875% 23 - 26.01.28	700 000	EUR	697 726	710 325	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.875% 23 - 14.02.28	400 000	EUR	398 601	410 312	0,04
BNP Paribas Cardif SA 1.00% 17 - 29.11.24	300 000	EUR	291 339	291 339	0,03
BNP Paribas Cardif SA FRN 14 - 29.11.49	700 000	EUR	688 549	689 780	0,06
BNP Paribas SA 0.125% 19 - 04.09.26	700 000	EUR	631 307	646 002	0,06
BNP Paribas SA FRN 21 - 13.04.27	700 000	EUR	637 527	649 607	0,06
BNP Paribas SA FRN 20 - 14.10.27	400 000	EUR	359 851	369 004	0,03
BNP Paribas SA FRN 19 - 15.07.25	600 000	EUR	578 781	588 840	0,06
BNP Paribas SA FRN 19 - 04.06.26	500 000	EUR	476 574	478 200	0,04
BNP Paribas SA FRN 20 - 19.02.28	800 000	EUR	710 154	727 976	0,07
BNP Paribas SA FRN 20 - 01.09.28	600 000	EUR	497 233	538 248	0,05
BNP Paribas SA FRN 21 - 30.05.28	600 000	EUR	522 004	543 276	0,05
BNP Paribas SA FRN 21 - 31.08.33	600 000	EUR	484 070	514 896	0,05
BNP Paribas SA 1.00% 17 - 27.06.24	400 000	EUR	392 954	394 352	0,04
BNP Paribas SA 1.00% 18 - 17.04.24	300 000	EUR	295 629	297 471	0,03
BNP Paribas SA 1.125% 18 - 11.06.26	800 000	EUR	754 918	761 536	0,07
BNP Paribas SA 1.125% 19 - 28.08.24	600 000	EUR	587 462	589 410	0,06
BNP Paribas SA FRN 20 - 15.01.32	700 000	EUR	613 704	638 309	0,06
BNP Paribas SA FRN 20 - 17.04.29	800 000	EUR	700 736	722 128	0,07
BNP Paribas SA 1.25% 18 - 19.03.25	600 000	EUR	584 516	583 476	0,05
BNP Paribas SA 1.50% 16 - 25.05.28	800 000	EUR	735 206	757 240	0,07
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 17.11.25	800 000	EUR	775 520	775 328	0,07
BNP Paribas SA 1.50% 17 - 23.05.28	600 000	EUR	542 636	562 392	0,05
BNP Paribas SA 1.625% 16 - 23.02.26	700 000	EUR	682 837	678 783	0,06
BNP Paribas SA FRN 19 - 23.01.27	1 400 000	EUR	1 369 483	1 360 156	0,13
BNP Paribas SA 2.25% 16 - 11.01.27	500 000	EUR	474 744	485 825	0,05
BNP Paribas SA 2.375% 14 - 20.05.24	580 000	EUR	584 572	576 276	0,05
BNP Paribas SA 2.375% 15 - 17.02.25	1 000 000	EUR	987 154	985 860	0,09
BNP Paribas SA FRN 18 - 20.11.30	300 000	EUR	290 604	291 312	0,03
BNP Paribas SA FRN 22 - 31.03.32	900 000	EUR	829 284	851 805	0,08
BNP Paribas SA 2.75% 15 - 27.01.26	600 000	EUR	595 161	594 642	0,06
BNP Paribas SA FRN 22 - 25.07.28	1 000 000	EUR	970 280	973 760	0,09
BNP Paribas SA 2.875% 16 - 01.10.26	300 000	EUR	290 949	296 709	0,03
BNP Paribas SA FRN 23 - 23.02.29	600 000	EUR	596 161	613 650	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 FRN 23 - 13.01.29	600 000	EUR	611 884	621 192	0,06
Bouygues SA 1.125% 20 - 24.07.28	900 000	EUR	814 917	838 656	0,08
Bouygues SA 1.375% 16 - 07.06.27	900 000	EUR	838 913	856 980	0,08
BPCE SA 0.01% 21 - 14.01.27	500 000	EUR	448 299	455 745	0,04
BPCE SA 0.125% 19 - 04.12.24	300 000	EUR	290 447	290 940	0,03
BPCE SA 0.25% 20 - 15.01.26	900 000	EUR	842 897	845 910	0,08
BPCE SA 0.375% 22 - 02.02.26	600 000	EUR	555 873	565 584	0,05
BPCE SA 0.50% 19 - 24.02.27	800 000	EUR	713 159	732 480	0,07
BPCE SA FRN 20 - 15.09.27	800 000	EUR	719 082	738 064	0,07
BPCE SA FRN 22 - 14.01.28	400 000	EUR	359 342	365 112	0,03
BPCE SA 0.625% 19 - 26.09.24	700 000	EUR	677 666	683 249	0,06
BPCE SA 0.625% 20 - 28.04.25	1 000 000	EUR	962 862	962 900	0,09
BPCE SA 1.00% 16 - 05.10.28	700 000	EUR	618 781	639 695	0,06
BPCE SA 1.00% 19 - 15.07.24	700 000	EUR	689 031	689 332	0,06
BPCE SA 1.00% 19 - 01.04.25	700 000	EUR	673 268	678 223	0,06
BPCE SA 1.375% 18 - 23.03.26	600 000	EUR	577 591	575 688	0,05
BPCE SA 1.625% 18 - 31.01.28	300 000	EUR	269 780	280 611	0,03
BPCE SA FRN 22 - 02.03.29	400 000	EUR	358 590	369 404	0,03
BPCE SA 1.75% 22 - 26.04.27	700 000	EUR	661 472	670 096	0,06
BPCE SA FRN 22 - 02.03.32	200 000	EUR	180 387	187 262	0,02
BPCE SA 2.875% 16 - 22.04.26	500 000	EUR	489 693	494 655	0,05
BPCE SA 3.00% 14 - 19.07.24	400 000	EUR	406 131	397 876	0,04
BPCE SA 3.50% 23 - 25.01.28	700 000	EUR	692 960	707 728	0,07
BPCE SA 3.625% 23 - 17.04.26	700 000	EUR	698 201	706 020	0,07
BPCE SA 4.125% 23 - 10.07.28	300 000	EUR	304 652	311 118	0,03
BPCE SA 4.375% 23 - 13.07.28	600 000	EUR	605 331	620 256	0,06
BPCE SA FRN 23 - 01.06.33	500 000	EUR	509 843	528 455	0,05
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 0.75% 21 - 07.07.28	300 000	EUR	252 660	266 106	0,02
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 3.375% 18 - 24.09.28	200 000	EUR	187 408	198 360	0,02
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 6.00% 17 - 23.01.27	400 000	EUR	429 494	429 744	0,04
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama FRN 14 - 29.05.49	500 000	EUR	512 193	500 715	0,05
Capgemini SE 0.625% 20 - 23.06.25	800 000	EUR	765 429	768 536	0,07
Capgemini SE 1.00% 18 - 18.10.24	600 000	EUR	589 921	586 764	0,06
Capgemini SE 1.625% 20 - 15.04.26	700 000	EUR	688 917	677 866	0,06
Capgemini SE 1.625% 20 - 15.04.26	100 000	EUR	98 828	96 838	0,01
Capgemini SE 1.75% 18 - 18.04.28	600 000	EUR	559 188	572 250	0,05
Carrefour Banque SA 0.107% 21 - 14.06.25	300 000	EUR	280 385	285 852	0,03
Carrefour Banque SA 4.079% 23 - 05.05.27	400 000	EUR	401 541	406 168	0,04
Carrefour SA 0.75% 16 - 26.04.24	720 000	EUR	706 260	713 023	0,07
Carrefour SA 1.00% 19 - 17.05.27	400 000	EUR	363 135	373 656	0,04
Carrefour SA 1.25% 15 - 03.06.25	800 000	EUR	769 856	776 080	0,07
Carrefour SA 1.75% 18 - 04.05.26	500 000	EUR	481 621	484 950	0,05
Carrefour SA 1.875% 22 - 30.10.26	900 000	EUR	856 643	869 994	0,08
Carrefour SA 2.625% 20 - 15.12.27	900 000	EUR	861 518	882 729	0,08

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Carrefour SA 4.125% 22 - 12.10.28	900 000	EUR	901 340	936 450	0,09
Cie de Saint-Gobain 0.625% 19 - 15.03.24	700 000	EUR	687 205	695 296	0,07
Cie de Saint-Gobain 1.00% 17 - 17.03.25	800 000	EUR	776 267	778 352	0,07
Cie de Saint-Gobain 1.125% 18 - 23.03.26	900 000	EUR	868 230	862 101	0,08
Cie de Saint-Gobain 1.375% 17 - 14.06.27	800 000	EUR	744 338	758 672	0,07
Cie de Saint-Gobain 1.625% 22 - 10.08.25	600 000	EUR	579 231	584 166	0,05
Cie de Saint-Gobain 2.125% 22 - 10.06.28	600 000	EUR	563 419	576 420	0,05
Cie de Saint-Gobain 2.375% 20 - 04.10.27	600 000	EUR	570 852	588 300	0,06
Cie de Saint-Gobain SA 1.875% 18 - 21.09.28	500 000	EUR	459 189	475 635	0,04
Cie de Saint-Gobain SA 3.75% 23 - 29.11.26	1 000 000	EUR	1 006 374	1 016 690	0,10
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 0.75% 16 - 09.09.28	400 000	EUR	352 386	366 620	0,03
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.125% 17 - 13.10.27	600 000	EUR	543 808	564 600	0,05
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA Zero Coupon 20 - 02.11.28	400 000	EUR	344 464	352 812	0,03
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.875% 18 - 03.09.25	800 000	EUR	777 146	770 600	0,07
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 1.75% 15 - 28.05.27	300 000	EUR	287 384	289 173	0,03
Cofiroute SA 0.375% 16 - 07.02.25	600 000	EUR	575 817	579 870	0,05
Covivio 1.50% 17 - 21.06.27	200 000	EUR	182 477	187 858	0,02
Covivio 1.625% 17 - 17.10.24	200 000	EUR	196 720	195 892	0,02
Covivio 1.875% 16 - 20.05.26	500 000	EUR	486 009	481 360	0,05
Covivio 2.375% 18 - 20.02.28	100 000	EUR	94 305	95 693	0,01
Credit Agricole Assurances SA FRN 18 - 29.01.48	600 000	EUR	540 321	557 742	0,05
Credit Agricole Assurances SA FRN 15 - 31.12.99	400 000	EUR	397 531	397 732	0,04
Credit Agricole Assurances SA FRN 14 - 31.10.49	700 000	EUR	695 539	696 759	0,07
Credit Agricole Assurances SA FRN 16 - 27.09.48	500 000	EUR	483 809	503 840	0,05
Credit Agricole SA 0.125% 20 - 09.12.27	700 000	EUR	591 077	621 054	0,06
Credit Agricole SA 0.375% 19 - 21.10.25	500 000	EUR	470 384	476 505	0,04
Credit Agricole SA 0.375% 21 - 20.04.28	600 000	EUR	515 857	530 082	0,05
Credit Agricole SA 0.50% 19 - 24.06.24	600 000	EUR	583 578	590 376	0,06
Credit Agricole SA FRN 21 - 21.09.29	700 000	EUR	585 304	610 729	0,06
Credit Agricole SA FRN 22 - 12.01.28	500 000	EUR	447 383	459 795	0,04
Credit Agricole SA 1.00% 17 - 16.09.24	600 000	EUR	589 541	588 246	0,06
Credit Agricole SA FRN 20 - 22.04.26	900 000	EUR	863 007	868 410	0,08
Credit Agricole SA 1.00% 22 - 18.09.25	800 000	EUR	767 977	772 592	0,07
Credit Agricole SA 1.25% 16 - 14.04.26	1 100 000	EUR	1 057 188	1 054 097	0,10
Credit Agricole SA 1.375% 17 - 03.05.27	800 000	EUR	745 380	758 096	0,07
Credit Agricole SA 1.375% 18 - 13.03.25	600 000	EUR	582 697	585 126	0,06
Credit Agricole SA FRN 20 - 05.06.30	400 000	EUR	376 644	386 496	0,04
Credit Agricole SA 1.875% 16 - 20.12.26	800 000	EUR	765 017	770 168	0,07
Credit Agricole SA FRN 22 - 22.04.27	500 000	EUR	472 757	482 190	0,05
Credit Agricole SA 2.375% 14 - 20.05.24	1 000 000	EUR	1 001 775	993 940	0,09
Credit Agricole SA 2.625% 15 - 17.03.27	1 112 000	EUR	1 067 550	1 078 651	0,10
Credit Agricole SA 3.125% 14 - 05.02.26	500 000	EUR	508 633	501 030	0,05
Credit Agricole SA 3.125% 14 - 05.02.26	100 000	EUR	98 266	100 206	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Agricole SA 3.375% 22 - 28.07.27	600 000	EUR	600 884	604 200	0,06
Credit Agricole SA FRN 22 - 12.10.26	700 000	EUR	699 589	705 726	0,07
Credit Agricole SA FRN 23 - 11.07.29	700 000	EUR	706 213	722 204	0,07
Credit Agricole SA FRN 23 - 28.08.33	700 000	EUR	706 804	735 000	0,07
Credit Mutuel Arkea SA 0.01% 20 - 28.01.26	400 000	EUR	372 878	374 660	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 0.375% 19 - 03.10.28	300 000	EUR	252 164	262 545	0,02
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 20 - 07.05.27	500 000	EUR	448 872	462 505	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 1.25% 17 - 31.05.24	300 000	EUR	298 972	296 670	0,03
Credit Mutuel Arkea SA FRN 20 - 11.06.29	500 000	EUR	438 967	453 900	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 1.375% 19 - 17.01.25	400 000	EUR	388 687	390 784	0,04
Credit Mutuel Arkea SA 1.625% 19 - 15.04.26	300 000	EUR	288 782	288 528	0,03
Credit Mutuel Arkea SA FRN 17 - 25.10.29	300 000	EUR	291 014	292 032	0,03
Credit Mutuel Arkea SA FRN 17 - 25.10.29	100 000	EUR	96 030	97 344	0,01
Credit Mutuel Arkea SA 3.25% 16 - 01.06.26	100 000	EUR	97 141	100 196	0,01
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 22 - 19.09.27	700 000	EUR	681 400	702 877	0,07
Credit Mutuel Arkea SA 3.875% 23 - 22.05.28	300 000	EUR	301 546	306 597	0,03
Dassault Systemes SE Zero Coupon 19 - 16.09.24	600 000	EUR	576 509	584 502	0,06
Dassault Systemes SE 0.125% 19 - 16.09.26	900 000	EUR	829 827	838 773	0,08
Edenred 1.375% 15 - 10.03.25	600 000	EUR	586 775	585 120	0,06
Edenred 1.875% 17 - 30.03.27	500 000	EUR	476 633	482 330	0,05
Edenred 1.875% 18 - 06.03.26	500 000	EUR	492 556	486 910	0,05
Edenred 3.625% 23 - 13.12.26	500 000	EUR	497 166	506 880	0,05
Elis SA 1.00% 19 - 03.04.25	400 000	EUR	383 976	384 988	0,04
Elis SA 1.75% 19 - 11.04.24	500 000	EUR	496 509	496 025	0,05
ELO SACA 2.375% 19 - 25.04.25	700 000	EUR	683 001	683 431	0,06
ELO SACA 2.875% 20 - 29.01.26	1 100 000	EUR	1 069 491	1 069 772	0,10
ELO SACA 3.25% 20 - 23.07.27	600 000	EUR	565 564	582 336	0,05
ELO SACA 4.875% 22 - 08.12.28	600 000	EUR	596 298	594 084	0,06
EssilorLuxottica SA 0.125% 19 - 27.05.25	1 600 000	EUR	1 527 435	1 529 360	0,14
EssilorLuxottica SA 0.375% 19 - 27.11.27	1 600 000	EUR	1 434 103	1 463 456	0,14
EssilorLuxottica SA 0.375% 20 - 05.01.26	1 300 000	EUR	1 242 405	1 234 376	0,12
EssilorLuxottica SA 0.50% 20 - 05.06.28	1 000 000	EUR	886 809	912 220	0,09
EssilorLuxottica SA 2.375% 14 - 09.04.24	300 000	EUR	302 245	299 037	0,03
EssilorLuxottica SA 2.625% 14 - 10.02.24	500 000	EUR	502 861	499 190	0,05
Firmenich Productions Participations SAS 1.375% 20 - 30.10.26	700 000	EUR	663 263	671 657	0,06
Gecina SA 1.375% 17 - 30.06.27	400 000	EUR	362 310	380 880	0,04
Gecina SA 1.375% 17 - 26.01.28	600 000	EUR	553 521	562 452	0,05
Gecina SA 1.50% 15 - 20.01.25	200 000	EUR	199 457	196 104	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 0.625% 21 - 14.09.28	700 000	EUR	597 629	618 261	0,06
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.625% 17 - 27.11.27	500 000	EUR	450 785	468 710	0,04
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 2.25% 14 - 24.03.25	800 000	EUR	782 844	784 240	0,07
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 2.50% 20 - 04.05.27	400 000	EUR	381 608	388 276	0,04
HSBC Continental Europe SA 0.10% 19 - 03.09.27	700 000	EUR	592 306	628 096	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Continental Europe SA 0.25% 19 - 17.05.24	600 000	EUR	583 709	591 552	0,06
HSBC Continental Europe SA 1.375% 18 - 04.09.28	700 000	EUR	635 649	645 351	0,06
ICADE 1.125% 16 - 17.11.25	400 000	EUR	377 929	380 776	0,04
ICADE 1.50% 17 - 13.09.27	500 000	EUR	445 217	465 160	0,04
ICADE 1.625% 18 - 28.02.28	400 000	EUR	361 759	371 948	0,03
ICADE 1.75% 16 - 10.06.26	400 000	EUR	390 375	381 840	0,04
Imerys SA 1.50% 17 - 15.01.27	500 000	EUR	455 327	468 740	0,04
Imerys SA 1.50% 17 - 15.01.27	100 000	EUR	92 956	93 748	0,01
Imerys SA 1.875% 16 - 31.03.28	200 000	EUR	183 068	184 934	0,02
Imerys SA 2.00% 14 - 10.12.24	500 000	EUR	492 439	490 110	0,05
JCDecaux SE 2.00% 20 - 24.10.24	600 000	EUR	593 956	590 370	0,06
JCDecaux SE 2.625% 20 - 24.04.28	600 000	EUR	571 707	587 718	0,06
Kering SA 0.75% 20 - 13.05.28	500 000	EUR	453 962	458 225	0,04
Kering SA 1.25% 16 - 10.05.26	600 000	EUR	580 881	576 666	0,05
Kering SA 1.25% 22 - 05.05.25	800 000	EUR	778 659	777 432	0,07
Kering SA 1.50% 17 - 05.04.27	400 000	EUR	378 548	382 960	0,04
Kering SA 2.75% 14 - 08.04.24	400 000	EUR	404 355	398 724	0,04
Kering SA 3.625% 23 - 05.09.27	800 000	EUR	803 800	818 144	0,08
Kering SA 3.75% 23 - 05.09.25	800 000	EUR	801 764	806 096	0,08
Klepierre SA 1.375% 17 - 16.02.27	400 000	EUR	371 201	379 072	0,04
Klepierre SA 1.75% 14 - 06.11.24	300 000	EUR	291 868	294 219	0,03
Klepierre SA 1.875% 16 - 19.02.26	300 000	EUR	288 773	291 891	0,03
Legrand SA 0.625% 19 - 24.06.28	500 000	EUR	445 344	456 980	0,04
Legrand SA 0.75% 17 - 06.07.24	500 000	EUR	489 184	492 135	0,05
Legrand SA 1.00% 18 - 06.03.26	200 000	EUR	193 272	192 454	0,02
Legrand SA 1.875% 15 - 16.12.27	200 000	EUR	185 612	191 936	0,02
L'Oreal SA 0.375% 22 - 29.03.24	1 200 000	EUR	1 179 804	1 189 836	0,11
L'Oreal SA 0.875% 22 - 29.06.26	1 300 000	EUR	1 244 250	1 239 498	0,12
L'Oreal SA 2.875% 23 - 19.05.28	900 000	EUR	888 693	904 554	0,09
L'Oreal SA 3.125% 23 - 19.05.25	1 000 000	EUR	996 905	998 470	0,09
L'Oreal SA 3.375% 23 - 23.01.27	800 000	EUR	803 457	813 088	0,08
Mercialys SA 1.80% 18 - 27.02.26	200 000	EUR	188 743	191 118	0,02
Nerval SAS 3.625% 22 - 20.07.28	100 000	EUR	94 913	99 395	0,01
New Immo Holdings SA 2.75% 19 - 26.11.26	200 000	EUR	171 275	183 960	0,02
Orange SA Zero Coupon 19 - 04.09.26	800 000	EUR	733 033	741 608	0,07
Orange SA Zero Coupon 19 - 04.09.26	100 000	EUR	92 096	92 701	0,01
Orange SA Zero Coupon 21 - 29.06.26	800 000	EUR	734 922	744 920	0,07
Orange SA 0.875% 16 - 03.02.27	800 000	EUR	751 279	753 712	0,07
Orange SA 1.00% 16 - 12.05.25	800 000	EUR	779 273	774 584	0,07
Orange SA 1.00% 18 - 12.09.25	1 000 000	EUR	962 823	963 900	0,09
Orange SA 1.125% 19 - 15.07.24	900 000	EUR	886 655	886 419	0,08
Orange SA 1.25% 20 - 07.07.27	800 000	EUR	751 100	757 976	0,07
Orange SA 1.375% 18 - 20.03.28	900 000	EUR	828 935	848 484	0,08
Orange SA 1.50% 17 - 09.09.27	400 000	EUR	370 548	383 648	0,04
Orange SA FRN 19 - 31.12.99	600 000	EUR	541 814	557 850	0,05
Orange SA FRN 20 - 31.12.99	700 000	EUR	591 519	620 739	0,06
Orange SA FRN 19 - 31.12.99	1 000 000	EUR	960 311	972 360	0,09
Orange SA FRN 14 - 29.10.49	1 000 000	EUR	1 033 068	1 020 720	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Publicis Groupe SA 1.625% 14 - 16.12.24	500 000	EUR	495 442	490 010	0,05
RCI Banque SA 0.50% 22 - 14.07.25	800 000	EUR	757 988	764 272	0,07
RCI Banque SA 1.125% 20 - 15.01.27	700 000	EUR	640 389	655 088	0,06
RCI Banque SA 1.375% 17 - 08.03.24	600 000	EUR	597 261	597 006	0,06
RCI Banque SA 1.625% 17 - 11.04.25	600 000	EUR	583 132	585 642	0,06
RCI Banque SA 1.625% 18 - 26.05.26	700 000	EUR	660 276	669 557	0,06
RCI Banque SA 1.75% 19 - 10.04.26	700 000	EUR	663 534	672 322	0,06
RCI Banque SA 2.00% 19 - 11.07.24	690 000	EUR	682 992	682 562	0,06
RCI Banque SA 4.125% 22 - 01.12.25	1 000 000	EUR	999 718	1 007 220	0,10
RCI Banque SA 4.50% 23 - 06.04.27	700 000	EUR	700 828	719 103	0,07
RCI Banque SA 4.625% 23 - 13.07.26	800 000	EUR	805 244	817 808	0,08
RCI Banque SA 4.625% 23 - 02.10.26	700 000	EUR	703 961	718 214	0,07
RCI Banque SA 4.75% 22 - 06.07.27	400 000	EUR	403 304	417 472	0,04
RCI Banque SA 4.875% 22 - 21.09.28	700 000	EUR	706 662	740 621	0,07
RCI Banque SA 4.875% 23 - 14.06.28	600 000	EUR	609 370	631 410	0,06
SANEF SA 0.95% 16 - 19.10.28	200 000	EUR	174 058	180 424	0,02
SANEF SA 1.875% 15 - 16.03.26	600 000	EUR	578 356	581 130	0,05
Sanofi 0.50% 16 - 13.01.27	1 100 000	EUR	1 027 630	1 032 229	0,10
Sanofi 0.625% 16 - 05.04.24	400 000	EUR	394 490	396 740	0,04
Sanofi 0.875% 22 - 06.04.25	900 000	EUR	871 475	873 252	0,08
Sanofi 1.00% 18 - 21.03.26	1 600 000	EUR	1 539 157	1 537 200	0,15
Sanofi 1.00% 20 - 01.04.25	1 000 000	EUR	978 354	971 380	0,09
Sanofi 1.125% 16 - 05.04.28	600 000	EUR	556 061	563 646	0,05
Sanofi 1.50% 15 - 22.09.25	800 000	EUR	787 474	779 552	0,07
Sanofi 1.75% 14 - 10.09.26	1 600 000	EUR	1 575 026	1 557 408	0,15
Schneider Electric SE 0.25% 16 - 09.09.24	900 000	EUR	870 949	879 066	0,08
Schneider Electric SE 0.875% 15 - 11.03.25	800 000	EUR	779 673	779 240	0,07
Schneider Electric SE 0.875% 17 - 13.12.26	600 000	EUR	564 173	571 020	0,05
Schneider Electric SE 1.00% 20 - 09.04.27	600 000	EUR	559 378	568 254	0,05
Schneider Electric SE 1.375% 18 - 21.06.27	800 000	EUR	757 585	763 024	0,07
Schneider Electric SE 1.50% 19 - 15.01.28	600 000	EUR	560 321	571 818	0,05
Schneider Electric SE 3.25% 22 - 09.11.27	600 000	EUR	605 073	609 240	0,06
Schneider Electric SE 3.25% 23 - 12.06.28	400 000	EUR	398 555	408 380	0,04
Schneider Electric SE 3.375% 23 - 06.04.25	800 000	EUR	799 882	800 568	0,08
SCOR SE FRN 15 - 08.06.46	400 000	EUR	383 851	388 660	0,04
SCOR SE FRN 16 - 27.05.48	300 000	EUR	277 507	295 353	0,03
Societe Fonciere Lyonnaise SA 0.50% 21 - 21.04.28	300 000	EUR	260 029	269 142	0,03
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 18 - 29.05.25	400 000	EUR	384 075	389 124	0,04
Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.50% 20 - 05.06.27	400 000	EUR	372 364	383 104	0,04
Societe Generale SA 0.125% 20 - 24.02.26	900 000	EUR	834 901	842 940	0,08
Societe Generale SA 0.125% 21 - 18.02.28	700 000	EUR	601 585	618 268	0,06
Societe Generale SA FRN 21 - 17.11.26	700 000	EUR	646 749	657 111	0,06
Societe Generale SA 0.25% 21 - 08.07.27	700 000	EUR	621 663	630 196	0,06
Societe Generale SA FRN 21 - 12.06.29	500 000	EUR	414 277	433 605	0,04
Societe Generale SA FRN 21 - 02.12.27	700 000	EUR	634 782	641 725	0,06
Societe Generale SA 0.75% 20 - 25.01.27	700 000	EUR	629 943	643 818	0,06
Societe Generale SA 0.875% 19 - 01.07.26	500 000	EUR	463 108	469 810	0,04
Societe Generale SA FRN 20 - 22.09.28	600 000	EUR	505 904	544 548	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 FRN 20 - 24.11.30	600 000	EUR	542 060	562 776	0,05
Societe Generale SA 1.125% 18 - 23.01.25	900 000	EUR	873 077	874 674	0,08
Societe Generale SA FRN 20 - 21.04.26	500 000	EUR	479 958	482 605	0,05
Societe Generale SA FRN 21 - 30.06.31	700 000	EUR	622 649	643 587	0,06
Societe Generale SA 1.25% 19 - 15.02.24	800 000	EUR	793 023	797 288	0,08
Societe Generale SA 1.375% 17 - 13.01.28	600 000	EUR	543 122	556 488	0,05
Societe Generale SA FRN 22 - 30.05.25	600 000	EUR	588 991	593 784	0,06
Societe Generale SA 2.125% 18 - 27.09.28	600 000	EUR	538 745	566 844	0,05
Societe Generale SA 2.625% 15 - 27.02.25	800 000	EUR	794 568	788 248	0,07
Societe Generale SA 4.00% 22 - 16.11.27	700 000	EUR	712 311	716 674	0,07
Societe Generale SA 4.125% 23 - 02.06.27	900 000	EUR	903 910	923 256	0,09
Societe Generale SA 4.125% 23 - 21.11.28	700 000	EUR	710 941	724 997	0,07
Societe Generale SA 4.25% 23 - 28.09.26	900 000	EUR	902 611	922 563	0,09
Societe Generale SA FRN 23 - 28.09.29	700 000	EUR	699 222	729 456	0,07
Societe Generale SA FRN 22 - 06.09.32	200 000	EUR	193 281	207 582	0,02
Sodexo SA 0.75% 16 - 14.04.27	600 000	EUR	546 464	569 046	0,05
Sodexo SA 0.75% 20 - 27.04.25	900 000	EUR	869 515	869 643	0,08
Sodexo SA 1.00% 20 - 17.07.28	600 000	EUR	538 593	551 532	0,05
Sodexo SA 2.50% 14 - 24.06.26	300 000	EUR	301 578	295 356	0,03
Sogecap SA FRN 14 - 29.12.49	500 000	EUR	475 674	492 770	0,05
Teleperformance 0.25% 20 - 26.11.27	600 000	EUR	508 873	535 506	0,05
Teleperformance 1.875% 18 - 02.07.25	500 000	EUR	488 209	484 510	0,05
Teleperformance SE 5.25% 23 - 22.11.28	700 000	EUR	714 865	732 921	0,07
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.625% 20 - 04.05.27	800 000	EUR	695 160	731 576	0,07
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.75% 21 - 25.10.28	400 000	EUR	336 645	358 724	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.875% 16 - 21.02.25	300 000	EUR	289 632	290 391	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 15 - 14.03.25	400 000	EUR	383 865	387 236	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 19 - 27.02.27	500 000	EUR	452 634	466 835	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.125% 16 - 28.04.27	300 000	EUR	270 880	283 551	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.125% 18 - 15.09.25	500 000	EUR	472 794	481 805	0,05
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 16 - 09.03.26	200 000	EUR	188 943	191 884	0,02
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.50% 17 - 22.02.28	300 000	EUR	267 607	280 809	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.125% 20 - 09.04.25	400 000	EUR	392 118	392 240	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.50% 14 - 26.02.24	400 000	EUR	401 728	399 028	0,04
Unibail-Rodamco-Westfield SE 2.50% 14 - 04.06.26	300 000	EUR	290 315	295 485	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN 18 - 31.12.99	400 000	EUR	335 005	351 244	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN 23 - 31.12.99	700 000	EUR	628 464	699 006	0,07
Verallia SA 1.625% 21 - 14.05.28	400 000	EUR	357 951	373 356	0,04
Vinci SA Zero Coupon 20 - 27.11.28	400 000	EUR	344 234	351 136	0,03
Vinci SA 1.00% 18 - 26.09.25	800 000	EUR	776 651	773 984	0,07
Vinci SA 3.375% 23 - 04.02.25	600 000	EUR	598 118	600 006	0,06
Vivendi SE 0.625% 19 - 11.06.25	700 000	EUR	670 967	673 281	0,06
Vivendi SE 0.875% 17 - 18.09.24	800 000	EUR	780 041	783 360	0,07
Vivendi SE 1.125% 19 - 11.12.28	800 000	EUR	762 648	758 416	0,07
Vivendi SE 1.875% 16 - 26.05.26	400 000	EUR	387 723	391 220	0,04
Wendel SE 2.50% 15 - 09.02.27	600 000	EUR	575 463	580 704	0,05
Worldline SA 0.25% 19 - 18.09.24	200 000	EUR	189 656	192 542	0,02
Worldline SA 0.875% 20 - 30.06.27	600 000	EUR	529 497	541 764	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Worldline SA 4.125% 23 - 12.09.28	600 000	EUR	592 100	593 580	0,06
WPP Finance SA 2.25% 14 - 22.09.26	600 000	EUR	580 229	587 574	0,06
WPP Finance SA 2.375% 20 - 19.05.27	720 000	EUR	692 028	705 996	0,07
WPP Finance SA 4.125% 23 - 30.05.28	800 000	EUR	806 774	825 192	0,08
			221 624 600	224 563 180	21,28
Allemagne					
Aareal Bank AG 0.05% 21 - 02.09.26	400 000	EUR	346 335	357 324	0,03
Aareal Bank AG 0.25% 20 - 23.11.27	400 000	EUR	322 681	341 692	0,03
Aareal Bank AG 0.375% 19 - 10.04.24	500 000	EUR	487 864	493 835	0,05
Aareal Bank AG 0.50% 20 - 07.04.27	200 000	EUR	171 993	176 984	0,02
Aareal Bank AG 0.75% 22 - 18.04.28	400 000	EUR	321 137	345 100	0,03
Aareal Bank AG 4.50% 22 - 25.07.25	400 000	EUR	402 915	400 908	0,04
adidas AG Zero Coupon 20 - 09.09.24	600 000	EUR	582 077	584 838	0,05
adidas AG Zero Coupon 20 - 05.10.28	300 000	EUR	253 929	264 801	0,02
adidas AG 3.00% 22 - 21.11.25	600 000	EUR	596 838	600 654	0,06
Albemarle New Holdings GmbH 1.125% 19 - 25.11.25	500 000	EUR	477 005	478 960	0,04
Albemarle New Holdings GmbH 1.625% 19 - 25.11.28	500 000	EUR	448 008	456 560	0,04
Allianz SE FRN 15 - 07.07.45	1 000 000	EUR	961 633	970 390	0,09
Allianz SE FRN 17 - 06.07.47	700 000	EUR	675 384	685 531	0,06
Allianz SE FRN 14 - 31.12.99	700 000	EUR	698 564	691 950	0,07
Allianz SE FRN 22 - 07.09.38	800 000	EUR	781 474	819 688	0,08
alstria office REIT-AG 0.50% 19 - 26.09.25	200 000	EUR	168 698	172 644	0,02
alstria office REIT-AG 1.50% 17 - 15.11.27	200 000	EUR	146 715	149 444	0,01
alstria office REIT-AG 1.50% 20 - 23.06.26	200 000	EUR	184 996	163 338	0,01
Amphenol Technologies Holdings GmbH 0.75% 20 - 04.05.26	420 000	EUR	394 499	398 290	0,04
Amphenol Technologies Holdings GmbH 2.00% 18 - 08.10.28	600 000	EUR	555 483	578 514	0,05
Berlin Hyp AG 0.375% 22 - 25.01.27	500 000	EUR	463 738	460 790	0,04
Berlin Hyp AG 1.00% 19 - 05.02.26	100 000	EUR	95 148	94 837	0,01
Berlin Hyp AG 1.125% 17 - 25.10.27	400 000	EUR	353 633	366 172	0,03
Berlin Hyp AG 1.25% 15 - 22.01.25	500 000	EUR	484 360	483 985	0,05
Berlin Hyp AG 1.50% 18 - 18.04.28	100 000	EUR	88 291	91 547	0,01
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.125% 16 - 27.04.26	600 000	EUR	581 779	576 114	0,05
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.25% 18 - 29.09.25	500 000	EUR	483 015	484 180	0,05
Bertelsmann SE & Co. KGaA 1.75% 14 - 14.10.24	200 000	EUR	197 752	196 308	0,02
Bertelsmann SE & Co. KGaA 2.00% 20 - 01.04.28	900 000	EUR	854 163	863 604	0,08
Clearstream Banking AG Zero Coupon 20 - 01.12.25	200 000	EUR	187 257	189 312	0,02
Commerzbank AG 0.10% 21 - 11.09.25	390 000	EUR	367 711	369 630	0,03
Commerzbank AG 0.25% 19 - 16.09.24	200 000	EUR	188 145	194 972	0,02
Commerzbank AG 0.375% 20 - 01.09.27	450 000	EUR	395 191	411 489	0,04
Commerzbank AG 0.50% 19 - 04.12.26	700 000	EUR	638 785	651 994	0,06
Commerzbank AG 0.625% 19 - 28.08.24	600 000	EUR	580 404	587 508	0,06
Commerzbank AG FRN 20 - 24.03.26	400 000	EUR	378 184	383 988	0,04
Commerzbank AG 0.875% 20 - 22.01.27	500 000	EUR	455 501	464 600	0,04
Commerzbank AG 1.00% 19 - 04.03.26	800 000	EUR	757 346	764 272	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Commerzbank AG 1.125% 17 - 24.05.24	400 000	EUR	396 070	395 488	0,04
Commerzbank AG 1.125% 17 - 19.09.25	100 000	EUR	94 153	96 274	0,01
Commerzbank AG 1.125% 19 - 22.06.26	300 000	EUR	277 001	284 319	0,03
Commerzbank AG 1.50% 18 - 28.08.28	200 000	EUR	181 734	190 864	0,02
Commerzbank AG 1.875% 18 - 28.02.28	300 000	EUR	270 729	284 826	0,03
Commerzbank AG FRN 22 - 14.09.27	400 000	EUR	386 615	391 568	0,04
Commerzbank AG FRN 22 - 21.03.28	500 000	EUR	492 090	511 685	0,05
Commerzbank AG FRN 23 - 25.03.29	400 000	EUR	404 189	420 140	0,04
Continental AG 0.375% 19 - 27.06.25	590 000	EUR	561 927	566 866	0,05
Continental AG 2.50% 20 - 27.08.26	790 000	EUR	778 214	780 544	0,07
Continental AG 3.625% 22 - 30.11.27	600 000	EUR	599 149	609 648	0,06
Continental AG 4.00% 23 - 01.06.28	800 000	EUR	800 032	825 544	0,08
Continental AG 4.00% 23 - 01.03.27	600 000	EUR	601 598	613 656	0,06
Covestro AG 0.875% 20 - 03.02.26	600 000	EUR	562 484	575 010	0,05
Covestro AG 1.75% 16 - 25.09.24	515 000	EUR	512 764	506 570	0,05
Covestro AG 4.75% 22 - 15.11.28	500 000	EUR	523 571	532 620	0,05
Deutsche Bank AG FRN 21 - 17.02.27	400 000	EUR	363 669	373 524	0,03
Deutsche Bank AG FRN 21 - 17.02.27	100 000	EUR	90 689	93 381	0,01
Deutsche Bank AG FRN 20 - 19.11.25	600 000	EUR	571 984	583 470	0,05
Deutsche Bank AG 1.125% 15 - 17.03.25	400 000	EUR	383 490	387 648	0,04
Deutsche Bank AG FRN 20 - 10.06.26	350 000	EUR	337 796	339 241	0,03
Deutsche Bank AG FRN 20 - 03.09.26	700 000	EUR	658 157	670 404	0,06
Deutsche Bank AG 1.625% 20 - 20.01.27	1 800 000	EUR	1 627 247	1 691 406	0,16
Deutsche Bank AG 1.75% 18 - 17.01.28	400 000	EUR	354 814	370 844	0,03
Deutsche Bank AG FRN 22 - 23.02.28	600 000	EUR	540 137	563 934	0,05
Deutsche Bank AG 2.625% 19 - 12.02.26	500 000	EUR	484 554	490 550	0,05
Deutsche Bank AG 2.75% 15 - 17.02.25	700 000	EUR	689 862	690 928	0,06
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.05.28	100 000	EUR	91 752	97 867	0,01
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.06.32	1 100 000	EUR	995 587	1 057 870	0,10
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.06.32	100 000	EUR	87 426	96 170	0,01
Deutsche Bank AG 4.00% 22 - 29.11.27	400 000	EUR	402 359	411 220	0,04
Deutsche Bank AG 4.50% 16 - 19.05.26	500 000	EUR	494 781	507 540	0,05
Deutsche Bank AG FRN 23 - 11.01.29	500 000	EUR	511 102	523 300	0,05
Deutsche Bank AG FRN 20 - 19.05.31	700 000	EUR	682 589	708 197	0,07
Deutsche Boerse AG Zero Coupon 21 - 22.02.26	400 000	EUR	371 919	375 784	0,04
Deutsche Boerse AG 1.125% 18 - 26.03.28	300 000	EUR	277 624	282 531	0,03
Deutsche Boerse AG FRN 20 - 16.06.47	300 000	EUR	253 282	271 035	0,03
Deutsche Boerse AG 1.625% 15 - 08.10.25	200 000	EUR	199 884	195 730	0,02
Deutsche Boerse AG FRN 22 - 23.06.48	400 000	EUR	354 921	361 736	0,03
Deutsche Boerse AG 3.875% 23 - 28.09.26	700 000	EUR	701 939	715 281	0,07
Deutsche Lufthansa AG 0.25% 19 - 06.09.24	500 000	EUR	487 499	485 375	0,05
Deutsche Lufthansa AG 2.00% 21 - 14.07.24	500 000	EUR	493 245	491 790	0,05
Deutsche Lufthansa AG 2.875% 21 - 11.02.25	700 000	EUR	689 931	686 042	0,06
Deutsche Lufthansa AG 2.875% 21 - 16.05.27	900 000	EUR	867 724	864 729	0,08
Deutsche Lufthansa AG 3.00% 20 - 29.05.26	1 000 000	EUR	975 287	973 000	0,09
Deutsche Lufthansa AG 3.75% 21 - 11.02.28	900 000	EUR	890 161	886 374	0,08
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.10% 21 - 02.02.26	300 000	EUR	270 431	268 749	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.125% 19 - 05.09.24	400 000	EUR	384 811	384 864	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.25% 21 - 27.10.25	500 000	EUR	450 886	453 370	0,04
Deutsche Pfandbriefbank AG 0.25% 22 - 17.01.25	200 000	EUR	189 438	189 334	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 4.375% 22 - 28.08.26	200 000	EUR	194 773	197 490	0,02
Deutsche Pfandbriefbank AG 5.00% 23 - 05.02.27	300 000	EUR	302 814	307 230	0,03
Deutsche Post AG 0.375% 20 - 20.05.26	700 000	EUR	654 824	658 539	0,06
Deutsche Post AG 1.00% 17 - 13.12.27	600 000	EUR	551 248	561 564	0,05
Deutsche Post AG 1.25% 16 - 01.04.26	500 000	EUR	483 167	485 375	0,05
Deutsche Post AG 1.625% 18 - 05.12.28	800 000	EUR	764 816	761 752	0,07
Deutsche Post AG 2.875% 12 - 11.12.24	650 000	EUR	665 515	645 918	0,06
Deutsche Telekom AG 0.50% 19 - 05.07.27	1 000 000	EUR	923 675	933 320	0,09
Deutsche Telekom AG 0.875% 19 - 25.03.26	500 000	EUR	478 291	478 465	0,04
Deutsche Wohnen SE 1.00% 20 - 30.04.25	300 000	EUR	289 115	287 328	0,03
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main 0.40% 21 - 17.11.28	100 000	EUR	84 488	85 282	0,01
Eurogrid GmbH 1.50% 16 - 18.04.28	800 000	EUR	736 953	747 648	0,07
Eurogrid GmbH 1.875% 15 - 10.06.25	500 000	EUR	495 878	488 730	0,05
Evonik Industries AG 0.375% 16 - 07.09.24	600 000	EUR	582 537	585 972	0,05
Evonik Industries AG 0.625% 20 - 18.09.25	500 000	EUR	476 257	477 610	0,04
Evonik Industries AG 0.625% 20 - 18.09.25	300 000	EUR	285 926	286 566	0,03
Evonik Industries AG 0.75% 16 - 07.09.28	300 000	EUR	263 966	275 349	0,03
Evonik Industries AG 2.25% 22 - 25.09.27	700 000	EUR	649 297	676 935	0,06
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 0.625% 19 - 30.11.26	660 000	EUR	605 247	603 920	0,06
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.00% 20 - 29.05.26	350 000	EUR	330 062	329 158	0,03
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 1.50% 18 - 11.07.25	550 000	EUR	541 042	530 926	0,05
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 3.875% 22 - 20.09.27	600 000	EUR	582 304	610 152	0,06
Fresenius SE & Co. KGaA 0.375% 20 - 28.09.26	500 000	EUR	457 242	464 750	0,04
Fresenius SE & Co. KGaA 0.75% 20 - 15.01.28	700 000	EUR	606 064	638 512	0,06
Fresenius SE & Co. KGaA 1.625% 20 - 08.10.27	690 000	EUR	619 453	652 374	0,06
Fresenius SE & Co. KGaA 1.875% 19 - 15.02.25	500 000	EUR	490 801	490 160	0,05
Fresenius SE & Co. KGaA 1.875% 22 - 24.05.25	790 000	EUR	767 421	772 952	0,07
Fresenius SE & Co. KGaA 4.25% 22 - 28.05.26	600 000	EUR	601 424	613 398	0,06
Hamburg Commercial Bank AG 0.375% 21 - 09.03.26	300 000	EUR	274 161	275 655	0,03
Hamburg Commercial Bank AG FRN 21 - 22.09.26	200 000	EUR	180 214	184 222	0,02
Hamburg Commercial Bank AG 4.875% 23 - 17.03.25	300 000	EUR	299 467	300 777	0,03
Hamburg Commercial Bank AG 4.875% 23 - 30.03.27	300 000	EUR	298 975	303 267	0,03
Hamburg Commercial Bank AG 6.25% 22 - 18.11.24	600 000	EUR	607 313	601 770	0,06
Hannover Rueck SE 1.125% 18 - 18.04.28	400 000	EUR	362 753	381 652	0,04
Hannover Rueck SE FRN 14 - 29.06.49	200 000	EUR	191 791	196 454	0,02
HeidelbergCement AG 1.50% 16 - 07.02.25	1 136 000	EUR	1 107 758	1 114 757	0,11
HeidelbergCement AG 2.25% 16 - 03.06.24	520 000	EUR	524 511	516 282	0,05
Hella GmbH & Co. KGaA 0.50% 19 - 26.01.27	520 000	EUR	463 291	473 824	0,04
Hella GmbH & Co. KGaA 1.00% 17 - 17.05.24	300 000	EUR	294 429	295 809	0,03
Henkel AG & Co. KGaA 2.625% 22 - 13.09.27	700 000	EUR	682 404	696 017	0,07
HOCHTIEF AG 0.50% 19 - 03.09.27	660 000	EUR	565 722	599 465	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
HOCHTIEF AG 1.75% 18 - 03.07.25	600 000	EUR	581 541	583 662	0,05
Infineon Technologies AG 0.625% 22 - 17.02.25	500 000	EUR	478 529	483 050	0,05
Infineon Technologies AG 1.125% 20 - 24.06.26	900 000	EUR	858 988	856 287	0,08
KION Group AG 1.625% 20 - 24.09.25	500 000	EUR	458 939	476 005	0,04
Knorr-Bremse AG 1.125% 18 - 13.06.25	600 000	EUR	584 677	582 096	0,05
Knorr-Bremse AG 3.25% 22 - 21.09.27	700 000	EUR	685 321	705 642	0,07
LANXESS AG Zero Coupon 21 - 08.09.27	500 000	EUR	414 773	433 620	0,04
LANXESS AG 1.00% 16 - 07.10.26	400 000	EUR	380 426	376 560	0,04
LANXESS AG 1.125% 18 - 16.05.25	620 000	EUR	597 522	598 374	0,06
LANXESS AG 1.75% 22 - 22.03.28	700 000	EUR	640 044	641 011	0,06
LEG Immobilien SE 0.375% 22 - 17.01.26	300 000	EUR	276 161	280 830	0,03
LEG Immobilien SE 0.875% 19 - 28.11.27	200 000	EUR	171 441	180 916	0,02
Merck Financial Services GmbH 0.125% 20 - 16.07.25	900 000	EUR	853 814	856 566	0,08
Merck Financial Services GmbH 0.375% 19 - 05.07.27	700 000	EUR	640 809	642 957	0,06
Merck Financial Services GmbH 0.50% 20 - 16.07.28	500 000	EUR	440 404	449 585	0,04
Merck Financial Services GmbH 1.875% 22 - 15.06.26	600 000	EUR	580 553	584 622	0,05
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	400 000	EUR	382 713	389 304	0,04
Merck KGaA FRN 20 - 09.09.80	800 000	EUR	719 408	742 216	0,07
Merck KGaA FRN 14 - 12.12.74	440 000	EUR	442 090	435 560	0,04
METRO AG 1.50% 15 - 19.03.25	500 000	EUR	486 127	484 955	0,05
Muenchener Hypothekenbank eG 0.50% 19 - 08.06.26	100 000	EUR	90 523	92 214	0,01
Muenchener Hypothekenbank eG 0.875% 17 - 11.07.24	200 000	EUR	194 303	196 572	0,02
Muenchener Hypothekenbank eG 0.875% 18 - 12.09.25	300 000	EUR	281 455	285 027	0,03
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 18 - 05.07.25	700 000	EUR	676 830	680 855	0,06
Robert Bosch GmbH 1.75% 14 - 08.07.24	600 000	EUR	596 383	593 274	0,06
Robert Bosch GmbH 3.625% 23 - 02.06.27	800 000	EUR	804 213	817 032	0,08
Santander Consumer Bank AG 0.25% 19 - 15.10.24	200 000	EUR	193 285	194 630	0,02
Santander Consumer Bank AG 4.375% 23 - 13.09.27	600 000	EUR	603 125	618 372	0,06
Santander Consumer Bank AG 4.50% 23 - 30.06.26	200 000	EUR	200 312	204 482	0,02
SAP SE 0.125% 20 - 18.05.26	800 000	EUR	748 153	752 680	0,07
SAP SE 0.75% 18 - 10.12.24	800 000	EUR	781 776	778 672	0,07
SAP SE 1.00% 15 - 01.04.25	400 000	EUR	395 546	391 676	0,04
SAP SE 1.00% 18 - 13.03.26	500 000	EUR	482 698	481 785	0,05
SAP SE 1.25% 18 - 10.03.28	900 000	EUR	835 820	852 741	0,08
SAP SE 1.75% 14 - 22.02.27	930 000	EUR	913 523	922 076	0,09
Talanx AG FRN 17 - 05.12.47	600 000	EUR	527 416	559 560	0,05
Talanx AG 2.50% 14 - 23.07.26	200 000	EUR	202 234	196 368	0,02
Vonovia SE Zero Coupon 21 - 01.12.25	800 000	EUR	729 125	745 912	0,07
Vonovia SE 0.25% 21 - 01.09.28	1 000 000	EUR	818 102	849 080	0,08
Vonovia SE 0.375% 21 - 16.06.27	400 000	EUR	341 554	357 600	0,03
Vonovia SE 1.375% 22 - 28.01.26	400 000	EUR	375 546	382 296	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Vonovia SE 1.875% 22 - 28.06.28	400 000	EUR	346 969	369 552	0,03
Vonovia SE 4.75% 22 - 23.05.27	500 000	EUR	505 307	518 495	0,05
			83 853 795	85 107 682	8,06
Guernesey					
Sirius Real Estate Ltd. 1.125% 21 - 22.06.26	300 000	EUR	262 749	270 489	0,02
Sirius Real Estate Ltd. 1.75% 21 - 24.11.28	100 000	EUR	81 178	82 657	0,01
			343 927	353 146	0,03
Hong Kong					
AIA Group Ltd. FRN 21 - 09.09.33	500 000	EUR	405 995	426 475	0,04
			405 995	426 475	0,04
Hongrie					
Erste Bank Hungary Zrt FRN 22 - 04.02.26	100 000	EUR	93 098	95 399	0,01
OTP Bank Nyrt FRN 22 - 13.07.25	300 000	EUR	300 419	301 494	0,03
OTP Bank Nyrt FRN 23 - 05.10.27	400 000	EUR	399 868	413 628	0,04
OTP Bank Nyrt FRN 22 - 04.03.26	300 000	EUR	300 674	307 971	0,03
Raiffeisen Bank zrt FRN 22 - 22.11.25	300 000	EUR	309 221	310 257	0,03
			1 403 280	1 428 749	0,14
Islande					
Arion Banki HF 0.375% 21 - 14.07.25	100 000	EUR	93 847	93 754	0,01
Arion Banki HF 4.875% 22 - 21.12.24	200 000	EUR	201 844	201 786	0,02
Arion Banki HF 7.25% 23 - 25.05.26	200 000	EUR	211 048	210 616	0,02
			506 739	506 156	0,05
Irlande					
Abbott Ireland Financing Dac 0.10% 19 - 19.11.24	400 000	EUR	382 369	387 516	0,04
Abbott Ireland Financing Dac 0.375% 19 - 19.11.27	600 000	EUR	536 868	549 540	0,05
Abbott Ireland Financing Dac 1.50% 18 - 27.09.26	1 250 000	EUR	1 190 981	1 206 312	0,11
AIB Group PLC FRN 21 - 17.11.27	300 000	EUR	265 419	275 274	0,02
AIB Group PLC 1.25% 19 - 28.05.24	400 000	EUR	394 013	395 564	0,04
AIB Group PLC 2.25% 18 - 03.07.25	400 000	EUR	388 184	393 056	0,04
AIB Group PLC FRN 22 - 04.04.28	600 000	EUR	552 096	575 394	0,05
AIB Group PLC FRN 22 - 04.07.26	500 000	EUR	493 960	500 020	0,05
AIB Group PLC FRN 23 - 23.07.29	500 000	EUR	503 032	515 935	0,05
AIB Group PLC FRN 22 - 16.02.29	600 000	EUR	619 256	644 904	0,06
Bank of Ireland Group PLC FRN 21 - 10.05.27	550 000	EUR	478 000	511 286	0,05
Bank of Ireland Group PLC FRN 19 - 25.11.25	500 000	EUR	474 398	486 880	0,05
Bank of Ireland Group PLC FRN 21 - 11.08.31	300 000	EUR	271 890	279 756	0,03
Bank of Ireland Group PLC FRN 22 - 05.06.26	730 000	EUR	688 120	709 961	0,07
Bank of Ireland Group PLC FRN 19 - 14.10.29	400 000	EUR	387 929	391 348	0,04
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 13.11.29	400 000	EUR	406 810	415 604	0,04
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 16.07.28	400 000	EUR	406 278	418 204	0,04
Bank of Ireland Group PLC FRN 22 - 01.03.33	400 000	EUR	418 487	432 232	0,04
CA Auto Bank SpA Zero Coupon 21 - 16.04.24	760 000	EUR	729 589	751 868	0,07
CA Auto Bank SpA 0.50% 19 - 13.09.24	700 000	EUR	676 618	683 179	0,06
CA Auto Bank SpA 4.25% 22 - 24.03.24	450 000	EUR	453 690	450 086	0,04
CA Auto Bank SpA 4.375% 23 - 08.06.26	800 000	EUR	804 273	812 616	0,08
CA Auto Bank SpA 4.75% 23 - 25.01.27	600 000	EUR	607 347	619 914	0,06
CCEP Finance Ireland Dac Zero Coupon 21 - 06.09.25	900 000	EUR	839 489	851 202	0,08
CRH Finance Dac 1.375% 16 - 18.10.28	700 000	EUR	626 758	647 472	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
CRH SMW Finance Dac 1.25% 20 - 05.11.26	620 000	EUR	587 987	590 736	0,05
CRH SMW Finance DAC 4.00% 23 - 11.07.27	600 000	EUR	605 471	616 560	0,06
Dell Bank International Dac 0.50% 21 - 27.10.26	560 000	EUR	507 757	518 067	0,05
Dell Bank International Dac 1.625% 20 - 24.06.24	460 000	EUR	453 427	454 839	0,04
Dell Bank International Dac 4.50% 22 - 18.10.27	520 000	EUR	519 184	541 710	0,05
DXC Capital Funding Dac 0.45% 21 - 15.09.27	720 000	EUR	603 273	639 130	0,06
Eaton Capital UnLtd Co. 0.128% 21 - 08.03.26	1 000 000	EUR	928 357	938 490	0,09
Eaton Capital UnLtd Co. 0.697% 19 - 14.05.25	620 000	EUR	595 507	597 296	0,06
Eaton Capital UnLtd Co. 0.75% 16 - 20.09.24	400 000	EUR	391 776	391 540	0,04
Fresenius Finance Ireland PLC Zero Coupon 21 - 01.10.25	400 000	EUR	370 678	376 664	0,03
Fresenius Finance Ireland PLC 0.50% 21 - 01.10.28	400 000	EUR	338 298	354 428	0,03
Fresenius Finance Ireland PLC 2.125% 17 - 01.02.27	940 000	EUR	909 759	909 347	0,09
Grenke Finance PLC 0.625% 19 - 09.01.25	400 000	EUR	369 189	382 872	0,04
Grenke Finance PLC 3.95% 20 - 09.07.25	300 000	EUR	284 854	297 690	0,03
Hammerson Ireland Finance Dac 1.75% 21 - 03.06.27	350 000	EUR	272 250	320 474	0,03
Johnson Controls International PLC 1.375% 16 - 25.02.25	500 000	EUR	485 869	486 280	0,04
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 0.375% 20 - 15.09.27	550 000	EUR	472 404	496 463	0,05
Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA 3.00% 22 - 15.09.28	600 000	EUR	575 508	597 546	0,06
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 2.375% 15 - 10.09.25	900 000	EUR	901 950	887 940	0,08
Liberty Mutual Finance Europe Dac 1.75% 17 - 27.03.24	200 000	EUR	198 841	198 656	0,02
Linde PLC Zero Coupon 21 - 30.09.26	700 000	EUR	638 083	646 345	0,06
Linde PLC 1.00% 22 - 31.03.27	600 000	EUR	560 727	567 132	0,05
Linde PLC 3.625% 23 - 12.06.25	400 000	EUR	400 091	402 432	0,04
Ryanair Dac 0.875% 21 - 25.05.26	1 310 000	EUR	1 203 791	1 236 692	0,12
Ryanair Dac 2.875% 20 - 15.09.25	900 000	EUR	887 190	891 297	0,08
Securitas Treasury Ireland DAC 4.25% 23 - 04.04.27	800 000	EUR	805 388	815 272	0,08
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.875% 18 - 15.01.26	1 100 000	EUR	1 097 155	1 083 709	0,10
Smurfit Kappa Treasury ULC 1.50% 19 - 15.09.27	650 000	EUR	576 576	610 343	0,06
			30 137 194	30 755 073	2,91
Italie					
Aeroporti di Roma SpA 1.625% 17 - 08.06.27	400 000	EUR	363 502	383 684	0,04
Anima Holdings SpA 1.50% 21 - 22.04.28	100 000	EUR	87 265	89 997	0,01
Assicurazioni Generali SpA 4.125% 14 - 04.05.26	500 000	EUR	512 521	503 330	0,05
Assicurazioni Generali SpA FRN 14 - 30.11.49	800 000	EUR	790 369	796 296	0,07
Assicurazioni Generali SpA FRN 16 - 08.06.48	600 000	EUR	606 162	618 174	0,06
Assicurazioni Generali SpA 5.125% 09 - 16.09.24	958 000	EUR	1 008 390	964 562	0,09
Assicurazioni Generali SpA FRN 15 - 27.10.47	780 000	EUR	774 305	810 358	0,08
ASTM SpA 1.00% 21 - 25.11.26	800 000	EUR	722 480	745 720	0,07
ASTM SpA 1.625% 18 - 08.02.28	400 000	EUR	357 075	375 180	0,03
ASTM SpA 3.375% 14 - 13.02.24	300 000	EUR	300 714	299 718	0,03
Banca Mediolanum SpA FRN 22 - 22.01.27	200 000	EUR	204 071	206 178	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Banco BPM SpA 0.875% 21 - 15.07.26	400 000	EUR	371 116	375 012	0,03
Banco BPM SpA 1.75% 19 - 28.01.25	400 000	EUR	389 773	390 756	0,04
Banco BPM SpA 2.50% 19 - 21.06.24	200 000	EUR	198 237	198 202	0,02
Banco BPM SpA 4.625% 23 - 29.11.27	300 000	EUR	303 013	309 246	0,03
Banco BPM SpA 4.875% 23 - 18.01.27	500 000	EUR	509 696	516 145	0,05
Credito Emiliano SpA FRN 22 - 19.01.28	400 000	EUR	364 461	370 580	0,03
FinecoBank Banca Fineco SpA FRN 21 - 21.10.27	200 000	EUR	180 740	182 096	0,02
FinecoBank Banca Fineco SpA FRN 23 - 23.02.29	200 000	EUR	198 515	203 922	0,02
Genertel SpA FRN 17 - 14.12.47	300 000	EUR	292 224	297 732	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 0.625% 21 - 24.02.26	550 000	EUR	490 926	517 022	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 19 - 04.12.24	500 000	EUR	482 985	486 460	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 21 - 16.03.28	800 000	EUR	700 604	720 624	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 04.07.24	800 000	EUR	785 682	788 024	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 19.11.26	750 000	EUR	693 507	703 065	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 1.50% 19 - 10.04.24	300 000	EUR	297 840	297 882	0,03
Intesa Sanpaolo SpA 1.625% 19 - 21.04.25	250 000	EUR	236 373	243 933	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 18 - 20.03.28	800 000	EUR	730 887	747 016	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 20 - 26.05.25	750 000	EUR	736 108	735 022	0,07
Intesa Sanpaolo SpA 2.625% 19 - 20.06.24	500 000	EUR	501 330	496 340	0,05
Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23 - 19.05.26	800 000	EUR	798 638	811 712	0,08
Intesa Sanpaolo SpA 4.375% 23 - 29.08.27	600 000	EUR	603 956	615 768	0,06
Intesa Sanpaolo SpA 4.50% 23 - 02.10.25	200 000	EUR	201 937	203 738	0,02
Intesa Sanpaolo SpA 4.75% 22 - 06.09.27	650 000	EUR	643 861	673 790	0,06
Intesa Sanpaolo SpA FRN 23 - 08.03.28	900 000	EUR	900 675	931 086	0,09
Lkq Italia Bondco Di Lkq Italia Bondco Gp SRL E C SAPA 3.875% 16 - 01.04.24	500 000	EUR	501 907	498 970	0,05
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.75% 20 - 15.07.27	100 000	EUR	89 606	91 070	0,01
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 21 - 02.11.28	250 000	EUR	205 598	224 285	0,02
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0.875% 19 - 15.01.26	300 000	EUR	280 679	285 420	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.00% 20 - 08.09.27	400 000	EUR	358 750	368 612	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 22 - 17.07.29	400 000	EUR	346 733	357 004	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.125% 19 - 15.07.25	300 000	EUR	288 867	288 762	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.125% 20 - 23.04.25	300 000	EUR	275 919	289 320	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.625% 19 - 07.01.25	300 000	EUR	293 433	293 127	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 22 - 07.02.29	300 000	EUR	298 080	312 240	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 14.03.28	500 000	EUR	502 012	516 710	0,05
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 13.09.27	300 000	EUR	299 868	308 421	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Pirelli & C SpA 4.25% 23 - 18.01.28	700 000	EUR	703 768	726 887	0,07
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.125% 19 - 25.07.25	700 000	EUR	655 834	664 062	0,06
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.00% 16 - 11.10.28	800 000	EUR	707 672	729 176	0,07
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.00% 19 - 10.04.26	600 000	EUR	573 501	572 370	0,05
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.375% 17 - 26.07.27	1 020 000	EUR	951 262	961 289	0,09
Terna - Rete Elettrica Nazionale 4.90% 04 - 28.10.24	600 000	EUR	630 829	605 196	0,06
UniCredit SpA 0.325% 21 - 19.01.26	600 000	EUR	550 985	564 966	0,05
UniCredit SpA 0.50% 19 - 09.04.25	700 000	EUR	666 119	672 644	0,06
UniCredit SpA FRN 21 - 05.07.29	400 000	EUR	345 542	355 648	0,03
UniCredit SpA FRN 22 - 18.01.28	860 000	EUR	770 727	798 544	0,07
UniCredit SpA FRN 20 - 20.01.26	750 000	EUR	703 960	727 965	0,07
UniCredit SpA FRN 19 - 25.06.25	720 000	EUR	696 163	709 546	0,07
UniCredit SpA FRN 20 - 16.06.26	720 000	EUR	677 931	694 966	0,07
UniCredit SpA FRN 19 - 03.07.25	500 000	EUR	493 940	493 490	0,05
UniCredit SpA 2.125% 16 - 24.10.26	600 000	EUR	577 093	584 676	0,05
UniCredit SpA FRN 20 - 22.07.27	750 000	EUR	719 028	724 522	0,07
UniCredit SpA FRN 23 - 16.02.29	850 000	EUR	831 761	869 584	0,08
UniCredit SpA FRN 23 - 17.01.29	600 000	EUR	606 399	627 972	0,06
UniCredit SpA FRN 22 - 15.11.27	600 000	EUR	616 727	635 658	0,06
			33 560 631	34 161 472	3,24
Japon					
East Japan Railway Co. 2.614% 22 - 08.09.25	700 000	EUR	688 082	691 957	0,07
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 21 - 08.06.27	400 000	EUR	369 298	371 776	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.339% 19 - 19.07.24	400 000	EUR	389 658	392 204	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.872% 17 - 07.09.24	450 000	EUR	442 223	440 874	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. 0.978% 20 - 09.06.24	200 000	EUR	198 197	197 356	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 22 - 14.06.25	560 000	EUR	550 004	555 072	0,05
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. FRN 22 - 19.09.25	900 000	EUR	888 799	894 321	0,09
Mizuho Financial Group Inc. 0.118% 19 - 06.09.24	300 000	EUR	287 635	292 488	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.184% 21 - 13.04.26	600 000	EUR	548 291	559 584	0,05
Mizuho Financial Group Inc. 0.214% 20 - 07.10.25	400 000	EUR	376 335	379 632	0,04
Mizuho Financial Group Inc. FRN 21 - 06.09.29	400 000	EUR	330 541	345 460	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.523% 19 - 10.06.24	300 000	EUR	291 167	295 473	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 0.956% 17 - 16.10.24	300 000	EUR	290 304	293 280	0,03
Mizuho Financial Group Inc. 1.598% 18 - 10.04.28	400 000	EUR	367 333	375 708	0,04
Mizuho Financial Group Inc. 1.631% 22 - 08.04.27	600 000	EUR	561 053	568 098	0,05
Mizuho Financial Group Inc. 3.49% 22 - 05.09.27	550 000	EUR	532 795	551 958	0,05
Mizuho Financial Group Inc. 4.157% 23 - 20.05.28	400 000	EUR	401 655	410 460	0,04
Nidec Corp. 0.046% 21 - 30.03.26	620 000	EUR	570 500	572 148	0,05
Nissan Motor Co. Ltd. 2.652% 20 - 17.03.26	800 000	EUR	765 853	780 872	0,07
Nissan Motor Co. Ltd. 3.201% 20 - 17.09.28	600 000	EUR	546 038	575 778	0,05
NTT Finance Corp. 0.01% 21 - 03.03.25	900 000	EUR	857 320	863 820	0,08

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
NTT Finance Corp. 0.082% 21 - 13.12.25	700 000	EUR	656 402	659 414	0,06
NTT Finance Corp. 0.399% 21 - 13.12.28	800 000	EUR	712 952	710 608	0,07
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.303% 20 - 28.10.27	170 000	EUR	143 223	152 689	0,01
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.465% 19 - 30.05.24	290 000	EUR	283 560	285 865	0,03
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 0.934% 17 - 11.10.24	290 000	EUR	287 462	283 501	0,03
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.413% 17 - 14.06.27	430 000	EUR	390 392	403 727	0,04
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. 1.546% 16 - 15.06.26	900 000	EUR	862 021	862 929	0,08
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0.75% 20 - 09.07.27	720 000	EUR	656 793	666 828	0,06
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.25% 18 - 21.11.26	1 650 000	EUR	1 622 373	1 612 083	0,15
			15 868 259	16 045 963	1,52
Jersey					
Aptiv PLC 1.50% 15 - 10.03.25	700 000	EUR	680 130	681 653	0,06
Aptiv PLC 1.60% 16 - 15.09.28	400 000	EUR	355 384	372 860	0,04
Heathrow Funding Ltd. 1.50% 20 - 12.10.25	700 000	EUR	668 407	678 055	0,06
			1 703 921	1 732 568	0,16
Corée					
Shinhan Bank Co. Ltd. 0.25% 19 - 16.10.24	200 000	EUR	192 272	194 028	0,02
			192 272	194 028	0,02
Luxembourg					
Acef Holdings SCA 0.75% 21 - 14.06.28	300 000	EUR	251 327	258 054	0,02
Aroundtown SA Zero Coupon 20 - 16.07.26	500 000	EUR	403 281	419 725	0,04
Aroundtown SA 0.375% 21 - 15.04.27	600 000	EUR	466 196	482 250	0,05
Aroundtown SA 0.625% 19 - 09.07.25	300 000	EUR	264 505	277 314	0,03
Aroundtown SA 1.00% 17 - 07.01.25	400 000	EUR	364 895	380 996	0,04
Aroundtown SA 1.45% 19 - 09.07.28	600 000	EUR	448 601	467 604	0,04
Aroundtown SA 1.50% 19 - 28.05.26	200 000	EUR	178 820	178 400	0,02
Aroundtown SA 1.625% 18 - 31.01.28	500 000	EUR	368 822	405 965	0,04
Aroundtown SA FRN 21 - 31.12.99	300 000	EUR	179 657	96 816	0,01
Aroundtown SA FRN 19 - 31.12.99	300 000	EUR	202 247	105 171	0,01
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 21 - 13.08.28	800 000	EUR	687 583	704 464	0,07
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 19 - 04.06.26	750 000	EUR	712 052	715 943	0,07
CNH Industrial Finance Europe SA Zero Coupon 20 - 01.04.24	700 000	EUR	683 927	692 944	0,07
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 17 - 12.09.25	700 000	EUR	680 239	681 212	0,06
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 19 - 25.03.27	420 000	EUR	392 754	402 154	0,04
CNH Industrial Finance Europe SA 1.875% 18 - 19.01.26	600 000	EUR	589 710	582 816	0,05
CPI Property Group SA 1.625% 19 - 23.04.27	400 000	EUR	318 469	293 020	0,03
CPI Property Group SA 2.75% 20 - 12.05.26	400 000	EUR	341 794	332 804	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl 2.125% 20 - 19.11.25	455 000	EUR	415 204	427 300	0,04
DH Europe Finance II Sarl 0.20% 19 - 18.03.26	1 250 000	EUR	1 162 884	1 173 437	0,11
DH Europe Finance II Sarl 0.45% 19 - 18.03.28	1 300 000	EUR	1 158 084	1 174 368	0,11
DH Europe Finance Sarl 1.20% 17 - 30.06.27	730 000	EUR	674 143	689 208	0,07
Eurofins Scientific SE 2.125% 17 - 25.07.24	500 000	EUR	498 162	494 235	0,05
Eurofins Scientific SE 3.75% 20 - 17.07.26	300 000	EUR	297 705	303 444	0,03
GELF Bond Issuer I SA 1.625% 16 - 20.10.26	200 000	EUR	173 234	190 126	0,02
Grand City Properties SA 0.125% 21 - 11.01.28	900 000	EUR	705 882	755 271	0,07
Grand City Properties SA 1.375% 17 - 03.08.26	300 000	EUR	264 991	276 456	0,03
Grand City Properties SA 1.50% 18 - 22.02.27	400 000	EUR	347 841	361 200	0,03
Grand City Properties SA FRN 20 - 31.12.99	400 000	EUR	293 209	180 080	0,02
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.125% 19 - 01.12.27	900 000	EUR	820 683	850 113	0,08
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.50% 17 - 14.06.27	340 000	EUR	310 049	326 247	0,03
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.625% 17 - 07.04.26	1 150 000	EUR	1 111 173	1 117 213	0,11
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.75% 18 - 24.04.28	700 000	EUR	645 554	667 625	0,06
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 2.50% 20 - 09.10.24	570 000	EUR	572 864	564 135	0,05
Highland Holdings Sarl 0.318% 21 - 15.12.26	700 000	EUR	633 280	645 841	0,06
Holcim Finance Luxembourg SA 0.125% 21 - 19.07.27	640 000	EUR	563 500	580 211	0,05
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 19 - 29.11.26	600 000	EUR	551 508	559 212	0,05
Holcim Finance Luxembourg SA 1.50% 22 - 06.04.25	600 000	EUR	580 221	584 430	0,06
Holcim Finance Luxembourg SA 2.25% 16 - 26.05.28	900 000	EUR	849 785	872 370	0,08
Holcim Finance Luxembourg SA 2.375% 20 - 09.04.25	520 000	EUR	518 519	513 198	0,05
Holcim Finance Luxembourg SA FRN 19 - 31.12.99	460 000	EUR	448 165	455 078	0,04
Holcim Finance Luxembourg SA FRN 19 - 31.12.99	100 000	EUR	96 631	98 930	0,01
John Deere Bank SA 2.50% 22 - 14.09.26	500 000	EUR	487 044	494 470	0,05
John Deere Cash Management SARL 1.375% 20 - 02.04.24	700 000	EUR	696 616	695 380	0,07
John Deere Cash Management SARL 1.85% 20 - 02.04.28	600 000	EUR	570 806	579 630	0,05
Medtronic Global Holdings SCA Zero Coupon 20 - 15.10.25	1 080 000	EUR	991 012	1 020 762	0,10
Medtronic Global Holdings SCA 0.25% 19 - 02.07.25	950 000	EUR	890 679	906 471	0,09
Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 20 - 15.10.28	1 000 000	EUR	865 195	889 540	0,08
Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 19 - 07.03.27	1 550 000	EUR	1 422 572	1 465 137	0,14
Medtronic Global Holdings SCA 2.625% 22 - 15.10.25	410 000	EUR	403 277	404 691	0,04
Medtronic Global Holdings SCA 3.00% 22 - 15.10.28	1 100 000	EUR	1 067 798	1 102 915	0,10
Mohawk Capital Finance SA 1.75% 20 - 12.06.27	500 000	EUR	466 396	472 710	0,04
Novartis Finance SA Zero Coupon 20 - 23.09.28	1 800 000	EUR	1 533 467	1 592 496	0,15

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Novartis Finance SA 0.625% 16 - 20.09.28	500 000	EUR	444 752	459 615	0,04
Novartis Finance SA 1.125% 17 - 30.09.27	660 000	EUR	606 063	629 845	0,06
Novartis Finance SA 1.625% 14 - 09.11.26	400 000	EUR	389 498	390 392	0,04
Richemont International Holdings SA 0.75% 20 - 26.05.28	460 000	EUR	417 532	422 156	0,04
Richemont International Holdings SA 1.00% 18 - 26.03.26	1 400 000	EUR	1 324 781	1 342 208	0,13
Segro Capital Sarl 1.25% 22 - 23.03.26	500 000	EUR	465 685	478 110	0,04
SES SA 0.875% 19 - 04.11.27	400 000	EUR	347 360	362 020	0,03
SES SA 1.625% 18 - 22.03.26	900 000	EUR	857 790	857 421	0,08
SES SA 2.00% 20 - 02.07.28	300 000	EUR	269 859	282 468	0,03
Simon International Finance SCA 1.25% 16 - 13.05.25	300 000	EUR	286 811	289 503	0,03
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 20 - 14.02.25	600 000	EUR	575 240	577 218	0,05
Whirlpool EMEA Finance Sarl 0.50% 20 - 20.02.28	560 000	EUR	485 316	496 160	0,05
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.10% 17 - 09.11.27	600 000	EUR	536 363	553 278	0,05
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.25% 16 - 02.11.26	320 000	EUR	301 535	302 403	0,03
			37 931 597	38 404 379	3,64
Mexique					
America Movil SAB de CV 0.75% 19 - 26.06.27	800 000	EUR	723 152	737 552	0,07
America Movil SAB de CV 1.50% 16 - 10.03.24	700 000	EUR	696 349	696 318	0,07
America Movil SAB de CV 2.125% 16 - 10.03.28	500 000	EUR	468 171	478 585	0,04
			1 887 672	1 912 455	0,18
Pays-Bas					
ABB Finance BV 0.625% 22 - 31.03.24	640 000	EUR	629 896	634 688	0,06
ABB Finance BV 0.75% 17 - 16.05.24	500 000	EUR	491 064	494 185	0,05
ABB Finance BV 3.25% 23 - 16.01.27	700 000	EUR	702 996	708 113	0,07
ABN AMRO Bank NV 0.50% 19 - 15.04.26	700 000	EUR	658 345	662 466	0,06
ABN AMRO Bank NV 0.60% 20 - 15.01.27	800 000	EUR	727 020	738 384	0,07
ABN AMRO Bank NV 0.875% 18 - 22.04.25	500 000	EUR	483 370	483 440	0,05
ABN AMRO Bank NV 1.00% 15 - 16.04.25	796 000	EUR	776 207	772 621	0,07
ABN AMRO Bank NV 1.25% 20 - 28.05.25	800 000	EUR	777 277	775 536	0,07
ABN AMRO Bank NV 2.375% 22 - 01.06.27	400 000	EUR	385 065	389 336	0,04
ABN AMRO Bank NV 3.625% 23 - 10.01.26	500 000	EUR	503 653	504 000	0,05
ABN AMRO Bank NV 3.75% 23 - 20.04.25	900 000	EUR	900 452	903 375	0,09
ABN AMRO Bank NV 3.875% 23 - 21.12.26	600 000	EUR	598 718	612 222	0,06
ABN AMRO Bank NV 4.00% 23 - 16.01.28	600 000	EUR	600 390	615 288	0,06
ABN AMRO Bank NV 4.375% 23 - 20.10.28	700 000	EUR	697 218	725 844	0,07
ABN AMRO Bank NV FRN 22 - 22.02.33	600 000	EUR	593 111	617 196	0,06
ABN AMRO Bank NV 5.50% 23 - 21.09.33	600 000	EUR	604 559	627 786	0,06
Achmea BV 1.50% 20 - 26.05.27	300 000	EUR	277 916	284 697	0,03
Achmea BV 3.625% 22 - 29.11.25	390 000	EUR	389 843	391 661	0,04
Achmea BV FRN 15 - 29.12.49	700 000	EUR	694 465	693 273	0,07
Adecco International Financial Services BV 0.125% 21 - 21.09.28	700 000	EUR	599 717	620 221	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.00% 16 - 02.12.24	100 000	EUR	97 422	97 526	0,01
Adecco International Financial Services BV FRN 21 - 21.03.82	550 000	EUR	432 126	477 340	0,04
Aegon Bank NV 0.625% 19 - 21.06.24	300 000	EUR	292 682	295 176	0,03
AGCO International Holdings BV 0.80% 21 - 06.10.28	500 000	EUR	425 499	437 870	0,04
Akzo Nobel NV 1.125% 16 - 08.04.26	420 000	EUR	399 392	402 965	0,04
Akzo Nobel NV 1.50% 22 - 28.03.28	600 000	EUR	551 052	563 604	0,05
Akzo Nobel NV 1.75% 14 - 07.11.24	420 000	EUR	416 402	412 696	0,04
Allianz Finance II BV Zero Coupon 20 - 14.01.25	300 000	EUR	288 041	289 947	0,03
Allianz Finance II BV Zero Coupon 21 - 22.11.26	500 000	EUR	459 496	463 950	0,04
Allianz Finance II BV 0.875% 17 - 06.12.27	400 000	EUR	359 928	375 380	0,04
Allianz Finance II BV 0.875% 19 - 15.01.26	600 000	EUR	575 124	576 714	0,05
Allianz Finance II BV 3.00% 13 - 13.03.28	500 000	EUR	504 693	508 105	0,05
American Medical Systems Europe BV 0.75% 22 - 08.03.25	980 000	EUR	931 800	947 395	0,09
American Medical Systems Europe BV 1.375% 22 - 08.03.28	600 000	EUR	550 527	561 552	0,05
Arcadis NV 4.875% 23 - 28.02.28	400 000	EUR	403 019	414 284	0,04
ASML Holding NV 3.50% 23 - 06.12.25	1 000 000	EUR	1 001 948	1 007 960	0,10
ASML Holdings NV 1.375% 16 - 07.07.26	1 000 000	EUR	970 511	964 060	0,09
ASML Holdings NV 1.625% 16 - 28.05.27	700 000	EUR	672 554	672 518	0,06
ASR Nederland NV 3.625% 23 - 12.12.28	400 000	EUR	406 592	405 888	0,04
ASR Nederland NV FRN 14 - 30.09.49	100 000	EUR	99 443	99 992	0,01
ASR Nederland NV FRN 15 - 29.09.45	400 000	EUR	414 484	404 208	0,04
Athora Netherlands NV FRN 21 - 15.07.31	300 000	EUR	263 551	267 183	0,02
Athora Netherlands NV FRN 22 - 31.08.32	270 000	EUR	251 014	258 836	0,02
BMW Finance NV Zero Coupon 21 - 11.01.26	900 000	EUR	844 324	849 591	0,08
BMW Finance NV 0.375% 19 - 24.09.27	700 000	EUR	631 594	645 309	0,06
BMW Finance NV 0.375% 20 - 14.01.27	840 000	EUR	780 457	783 854	0,07
BMW Finance NV 0.50% 22 - 22.02.25	1 000 000	EUR	961 421	966 500	0,09
BMW Finance NV 0.75% 16 - 15.04.24	905 000	EUR	893 862	896 583	0,08
BMW Finance NV 0.75% 17 - 12.07.24	649 000	EUR	640 623	638 629	0,06
BMW Finance NV 0.75% 19 - 13.07.26	735 000	EUR	700 042	696 493	0,07
BMW Finance NV 0.875% 17 - 03.04.25	735 000	EUR	717 855	713 112	0,07
BMW Finance NV 1.00% 15 - 21.01.25	820 000	EUR	799 252	798 401	0,08
BMW Finance NV 1.00% 18 - 29.08.25	830 000	EUR	809 939	802 270	0,08
BMW Finance NV 1.00% 18 - 14.11.24	1 100 000	EUR	1 082 749	1 074 920	0,10
BMW Finance NV 1.00% 22 - 22.05.28	800 000	EUR	727 766	741 960	0,07
BMW Finance NV 1.125% 18 - 10.01.28	600 000	EUR	550 973	561 852	0,05
BMW Finance NV 1.125% 18 - 22.05.26	824 000	EUR	792 985	789 928	0,07
BMW Finance NV 3.25% 23 - 22.11.26	900 000	EUR	898 403	907 803	0,09
BMW Finance NV 3.50% 23 - 06.04.25	500 000	EUR	500 194	500 960	0,05
BMW Finance NV 3.50% 23 - 19.10.24	200 000	EUR	200 151	199 436	0,02
BMW Finance NV 3.875% 23 - 04.10.28	500 000	EUR	505 828	522 810	0,05
Brenntag Finance BV 1.125% 17 - 27.09.25	700 000	EUR	671 319	674 219	0,06
Coca-Cola HBC Finance BV 1.00% 19 - 14.05.27	800 000	EUR	727 993	749 576	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Coca-Cola HBC Finance BV 1.875% 16 - 11.11.24	500 000	EUR	498 299	491 480	0,05
Coca-Cola HBC Finance BV 2.75% 22 - 23.09.25	550 000	EUR	542 850	544 907	0,05
Coloplast Finance BV 2.25% 22 - 19.05.27	900 000	EUR	866 932	873 405	0,08
Compass Group Finance Netherlands BV 0.625% 17 - 03.07.24	720 000	EUR	701 136	707 940	0,07
Compass Group Finance Netherlands BV 1.50% 18 - 05.09.28	400 000	EUR	361 522	377 416	0,04
Conti-Gummi Finance BV 1.125% 20 - 25.09.24	480 000	EUR	468 706	470 146	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 19 - 30.10.26	400 000	EUR	372 206	372 732	0,03
Cooperatieve Rabobank UA FRN 21 - 01.12.27	700 000	EUR	629 882	642 096	0,06
Cooperatieve Rabobank UA 0.625% 19 - 27.02.24	900 000	EUR	890 458	895 392	0,08
Cooperatieve Rabobank UA FRN 20 - 05.05.28	700 000	EUR	620 905	645 239	0,06
Cooperatieve Rabobank UA 1.25% 16 - 23.03.26	1 200 000	EUR	1 168 852	1 156 824	0,11
Cooperatieve Rabobank UA 1.375% 15 - 03.02.27	750 000	EUR	718 861	713 100	0,07
Cooperatieve Rabobank UA FRN 22 - 30.11.32	400 000	EUR	390 863	399 916	0,04
Cooperatieve Rabobank UA 3.913% 23 - 03.11.26	700 000	EUR	703 077	715 841	0,07
Cooperatieve Rabobank UA 4.125% 10 - 14.07.25	1 700 000	EUR	1 796 592	1 719 550	0,16
Cooperatieve Rabobank UA FRN 23 - 25.04.29	800 000	EUR	802 711	823 280	0,08
Cooperatieve Rabobank UA FRN 22 - 27.01.28	700 000	EUR	712 136	724 822	0,07
CTP NV 0.50% 21 - 21.06.25	300 000	EUR	278 599	282 510	0,03
CTP NV 0.625% 21 - 27.09.26	300 000	EUR	259 112	269 883	0,03
CTP NV 0.75% 21 - 18.02.27	300 000	EUR	253 833	267 114	0,02
CTP NV 0.875% 22 - 20.01.26	400 000	EUR	360 881	370 888	0,03
CTP NV 2.125% 20 - 01.10.25	200 000	EUR	189 866	192 062	0,02
Daimler Truck International Finance BV 1.25% 22 - 06.04.25	700 000	EUR	676 755	680 589	0,06
Daimler Truck International Finance BV 1.625% 22 - 06.04.27	600 000	EUR	560 001	574 140	0,05
Daimler Truck International Finance BV 3.875% 23 - 19.06.26	600 000	EUR	599 924	610 116	0,06
Deutsche Telekom International Finance BV 0.625% 17 - 13.12.24	700 000	EUR	680 920	681 121	0,06
Deutsche Telekom International Finance BV 1.125% 17 - 22.05.26	650 000	EUR	628 373	627 276	0,06
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 17 - 30.01.27	1 040 000	EUR	1 000 085	999 908	0,09
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 18 - 01.12.25	930 000	EUR	907 298	904 546	0,09
Deutsche Telekom International Finance BV 1.50% 16 - 03.04.28	1 400 000	EUR	1 308 659	1 328 278	0,13
Deutsche Telekom International Finance BV 2.75% 12 - 24.10.24	400 000	EUR	405 341	397 724	0,04
Deutsche Telekom International Finance BV 3.25% 13 - 17.01.28	700 000	EUR	704 707	719 775	0,07
Deutsche Telekom International Finance BV 4.875% 10 - 22.04.25	500 000	EUR	529 998	514 730	0,05
Digital Dutch Finco BV 0.625% 20 - 15.07.25	600 000	EUR	564 613	568 404	0,05
DSM BV 0.25% 20 - 23.06.28	600 000	EUR	522 823	540 078	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
DSM BV 0.75% 16 - 28.09.26	700 000	EUR	653 093	665 196	0,06
DSM BV 1.00% 15 - 09.04.25	500 000	EUR	483 257	485 965	0,05
DSM BV 2.375% 14 - 03.04.24	500 000	EUR	498 208	497 970	0,05
easyJet FinCo BV 1.875% 21 - 03.03.28	1 100 000	EUR	989 488	1 028 148	0,10
Essity Capital BV 3.00% 22 - 21.09.26	540 000	EUR	533 016	538 531	0,05
Euronext NV 0.125% 21 - 17.05.26	500 000	EUR	451 612	464 920	0,04
Euronext NV 1.00% 18 - 18.04.25	300 000	EUR	292 095	289 872	0,03
EXOR NV 1.75% 18 - 18.01.28	500 000	EUR	460 613	478 475	0,04
EXOR NV 2.50% 14 - 08.10.24	300 000	EUR	306 497	296 859	0,03
Givaudan Finance Europe BV 1.00% 20 - 22.04.27	620 000	EUR	578 829	588 188	0,06
GSK Capital BV 3.00% 22 - 28.11.27	600 000	EUR	603 113	604 812	0,06
Haleon Netherlands Capital BV 1.25% 22 - 29.03.26	900 000	EUR	852 275	863 415	0,08
IMCD NV 2.125% 22 - 31.03.27	200 000	EUR	183 004	191 128	0,02
IMCD NV 4.875% 23 - 18.09.28	400 000	EUR	396 161	419 268	0,04
ING Bank NV 4.125% 23 - 02.10.26	700 000	EUR	703 428	717 122	0,07
ING Groep NV FRN 19 - 03.09.25	500 000	EUR	474 984	487 290	0,05
ING Groep NV FRN 21 - 29.11.25	700 000	EUR	661 354	676 025	0,06
ING Groep NV FRN 20 - 18.02.29	700 000	EUR	587 493	607 418	0,06
ING Groep NV FRN 21 - 29.09.28	900 000	EUR	743 790	798 903	0,08
ING Groep NV FRN 21 - 09.06.32	400 000	EUR	333 186	359 244	0,03
ING Groep NV FRN 19 - 13.11.30	700 000	EUR	633 149	655 795	0,06
ING Groep NV FRN 21 - 16.11.32	500 000	EUR	419 685	442 145	0,04
ING Groep NV 1.125% 18 - 14.02.25	600 000	EUR	586 048	584 304	0,05
ING Groep NV FRN 22 - 16.02.27	900 000	EUR	843 898	855 963	0,08
ING Groep NV 1.375% 17 - 11.01.28	600 000	EUR	541 415	564 450	0,05
ING Groep NV FRN 17 - 26.09.29	500 000	EUR	478 803	487 535	0,05
ING Groep NV FRN 18 - 22.03.30	700 000	EUR	673 438	676 935	0,06
ING Groep NV 2.00% 18 - 20.09.28	1 000 000	EUR	923 384	950 560	0,09
ING Groep NV 2.125% 19 - 10.01.26	700 000	EUR	683 778	685 629	0,06
ING Groep NV FRN 20 - 26.05.31	900 000	EUR	849 063	858 582	0,08
ING Groep NV FRN 22 - 23.05.26	1 000 000	EUR	968 732	978 380	0,09
ING Groep NV FRN 17 - 15.02.29	400 000	EUR	397 967	398 948	0,04
ING Groep NV FRN 22 - 24.08.33	600 000	EUR	570 829	602 010	0,06
ING Groep NV FRN 23 - 23.05.29	1 000 000	EUR	1 004 240	1 030 630	0,10
ING Groep NV FRN 22 - 14.11.27	800 000	EUR	820 370	829 712	0,08
ISS Finance BV 1.25% 20 - 07.07.25	600 000	EUR	573 719	577 284	0,05
JDE Peet's NV Zero Coupon 21 - 16.01.26	620 000	EUR	561 369	579 551	0,05
JDE Peet's NV 0.244% 21 - 16.01.25	600 000	EUR	568 189	577 542	0,05
JDE Peet's NV 0.625% 21 - 09.02.28	500 000	EUR	432 472	447 995	0,04
Koninklijke Ahold Delhaize NV 0.25% 19 - 26.06.25	700 000	EUR	670 671	671 769	0,06
Koninklijke Ahold Delhaize NV 0.875% 17 - 19.09.24	600 000	EUR	586 134	587 958	0,06
Koninklijke Ahold Delhaize NV 1.125% 18 - 19.03.26	500 000	EUR	480 444	481 750	0,05
Koninklijke Ahold Delhaize NV 1.75% 20 - 02.04.27	520 000	EUR	494 672	502 429	0,05
Koninklijke Ahold Delhaize NV 3.50% 23 - 04.04.28	500 000	EUR	501 194	510 385	0,05
Koninklijke KPN NV 0.625% 16 - 09.04.25	700 000	EUR	672 699	674 996	0,06
Koninklijke KPN NV 1.125% 16 - 11.09.28	400 000	EUR	354 629	369 128	0,03
Koninklijke KPN NV 5.625% 09 - 30.09.24	600 000	EUR	624 009	607 188	0,06
LeasePlan Corp. NV 0.25% 21 - 23.02.26	600 000	EUR	548 042	559 062	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.25% 21 - 07.09.26	600 000	EUR	537 964	551 172	0,05
LeasePlan Corp. NV 1.375% 19 - 07.03.24	200 000	EUR	197 769	199 048	0,02
LeasePlan Corp. NV 2.125% 22 - 06.05.25	500 000	EUR	483 555	491 010	0,05
LeasePlan Corp. NV 3.50% 20 - 09.04.25	400 000	EUR	399 364	399 692	0,04
Linde Finance BV 0.25% 20 - 19.05.27	600 000	EUR	538 245	551 034	0,05
Linde Finance BV 1.00% 16 - 20.04.28	800 000	EUR	749 335	752 688	0,07
Linde Finance BV 1.875% 14 - 22.05.24	300 000	EUR	304 198	298 014	0,03
Lseg Netherlands BV Zero Coupon 21 - 06.04.25	300 000	EUR	285 355	287 556	0,03
Lseg Netherlands BV 0.25% 21 - 06.04.28	400 000	EUR	355 772	356 588	0,03
Lseg Netherlands BV 4.125% 23 - 29.09.26	500 000	EUR	503 291	512 880	0,05
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.375% 19 - 26.02.25	500 000	EUR	477 683	481 715	0,05
Nationale-Nederlanden Bank NV 0.50% 21 - 21.09.28	300 000	EUR	253 020	264 630	0,02
NE Property BV 1.75% 17 - 23.11.24	500 000	EUR	479 038	483 610	0,05
NE Property BV 1.875% 19 - 09.10.26	200 000	EUR	171 080	182 698	0,02
NE Property BV 3.375% 20 - 14.07.27	400 000	EUR	363 292	376 776	0,04
NIBC Bank NV 0.25% 21 - 09.09.26	500 000	EUR	439 208	457 265	0,04
NIBC Bank NV 0.875% 19 - 08.07.25	300 000	EUR	279 455	286 878	0,03
NIBC Bank NV 0.875% 22 - 24.06.27	300 000	EUR	260 750	273 231	0,03
NIBC Bank NV 2.00% 19 - 09.04.24	300 000	EUR	297 880	298 005	0,03
NIBC Bank NV 6.00% 23 - 16.11.28	400 000	EUR	419 122	425 056	0,04
NIBC Bank NV 6.375% 23 - 01.12.25	300 000	EUR	300 032	314 271	0,03
NN Group NV 1.625% 17 - 01.06.27	350 000	EUR	329 440	336 676	0,03
NN Group NV FRN 14 - 29.06.49	300 000	EUR	302 458	298 935	0,03
NN Group NV FRN 14 - 15.07.49	500 000	EUR	503 551	498 025	0,05
NN Group NV FRN 14 - 08.04.44	200 000	EUR	200 624	199 798	0,02
NN Group NV FRN 17 - 13.01.48	500 000	EUR	487 666	501 050	0,05
Novo Nordisk Finance Netherlands BV Zero Coupon 21 - 04.06.24	600 000	EUR	587 518	590 352	0,06
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.125% 21 - 04.06.28	600 000	EUR	525 556	538 758	0,05
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.75% 22 - 31.03.25	500 000	EUR	483 748	484 755	0,05
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 1.125% 22 - 30.09.27	650 000	EUR	595 903	616 011	0,06
OCI NV 3.625% 20 - 15.10.25	279 000	EUR	276 146	276 271	0,03
PACCAR Financial Europe BV Zero Coupon 21 - 01.03.26	500 000	EUR	462 303	467 225	0,04
PACCAR Financial Europe BV 3.25% 22 - 29.11.25	500 000	EUR	501 240	500 680	0,05
PACCAR Financial Europe BV 3.375% 23 - 15.05.26	400 000	EUR	398 909	403 896	0,04
PostNL NV 0.625% 19 - 23.09.26	500 000	EUR	461 360	462 910	0,04
PostNL NV 1.00% 17 - 21.11.24	200 000	EUR	195 074	194 942	0,02
Prosus NV 1.207% 22 - 19.01.26	500 000	EUR	461 112	469 935	0,04
Prosus NV 1.539% 20 - 03.08.28	800 000	EUR	669 169	690 112	0,06
Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 0.375% 20 - 19.05.26	710 000	EUR	669 416	669 587	0,06
RELX Finance BV Zero Coupon 20 - 18.03.24	600 000	EUR	584 631	594 936	0,06
RELX Finance BV 0.50% 20 - 10.03.28	900 000	EUR	799 801	816 183	0,08

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
RELX Finance BV 1.00% 17 - 22.03.24	600 000	EUR	592 692	595 980	0,06
RELX Finance BV 1.375% 16 - 12.05.26	640 000	EUR	614 482	618 304	0,06
RELX Finance BV 1.50% 18 - 13.05.27	500 000	EUR	470 916	478 660	0,04
Rentokil Initial Finance BV 3.875% 22 - 27.06.27	880 000	EUR	898 085	896 940	0,08
Robert Bosch Investment Nederland BV 2.625% 13 - 24.05.28	800 000	EUR	779 390	791 208	0,07
Roche Finance Europe BV 0.875% 15 - 25.02.25	1 133 000	EUR	1 109 861	1 106 239	0,10
Roche Finance Europe BV 3.312% 23 - 04.12.27	600 000	EUR	606 705	614 124	0,06
Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 21 - 26.01.28	350 000	EUR	287 634	299 037	0,03
Sagax Euro Mtn NL BV 1.625% 22 - 24.02.26	200 000	EUR	182 104	189 570	0,02
Sandoz Finance BV 3.97% 23 - 17.04.27	800 000	EUR	817 400	815 928	0,08
Sartorius Finance BV 4.25% 23 - 14.09.26	600 000	EUR	602 376	613 404	0,06
SGS Nederland Holdings BV 0.125% 21 - 21.04.27	700 000	EUR	615 361	635 460	0,06
Siemens Energy Finance BV 4.00% 23 - 05.04.26	600 000	EUR	602 334	592 080	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 19 - 05.09.24	360 000	EUR	349 614	351 050	0,03
Siemens Financieringsmaatschappij NV Zero Coupon 20 - 20.02.26	1 000 000	EUR	939 919	942 110	0,09
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.25% 20 - 05.06.24	1 000 000	EUR	981 776	984 760	0,09
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.30% 19 - 28.02.24	690 000	EUR	681 115	686 005	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.375% 20 - 05.06.26	1 200 000	EUR	1 134 486	1 132 032	0,11
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.625% 22 - 25.02.27	500 000	EUR	462 060	467 715	0,04
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.90% 19 - 28.02.28	600 000	EUR	546 208	560 832	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.00% 18 - 06.09.27	720 000	EUR	665 167	685 339	0,06
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.25% 22 - 10.03.25	1 100 000	EUR	1 085 653	1 085 469	0,10
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.50% 22 - 08.09.27	500 000	EUR	485 440	497 270	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.875% 13 - 10.03.28	1 000 000	EUR	997 530	1 011 360	0,10
Signify NV 2.00% 20 - 11.05.24	590 000	EUR	586 610	585 138	0,05
Signify NV 2.375% 20 - 11.05.27	610 000	EUR	582 347	591 548	0,06
Sika Capital BV 0.875% 19 - 29.04.27	630 000	EUR	575 549	588 741	0,06
Sika Capital BV 3.75% 23 - 03.11.26	1 000 000	EUR	1 004 058	1 016 560	0,10
Sudzucker International Finance BV 1.00% 17 - 28.11.25	500 000	EUR	475 553	476 090	0,04
Sudzucker International Finance BV 5.125% 22 - 31.10.27	400 000	EUR	406 219	422 164	0,04
Thermo Fisher Scientific Finance I BV Zero Coupon 21 - 18.11.25	600 000	EUR	558 675	566 124	0,05
Universal Music Group NV 3.00% 22 - 30.06.27	600 000	EUR	594 182	600 288	0,06
Vonovia Finance BV 0.625% 19 - 07.10.27	300 000	EUR	246 073	268 521	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.625% 20 - 09.07.26	400 000	EUR	359 022	373 044	0,03
Vonovia Finance BV 1.125% 17 - 08.09.25	300 000	EUR	288 557	287 175	0,03
Vonovia Finance BV 1.25% 16 - 06.12.24	400 000	EUR	386 654	389 752	0,04
Vonovia Finance BV 1.50% 15 - 31.03.25	490 000	EUR	471 453	476 393	0,04
Vonovia Finance BV 1.50% 16 - 10.06.26	400 000	EUR	385 800	381 548	0,04
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 14.01.28	300 000	EUR	263 078	274 761	0,03
Vonovia Finance BV 1.50% 18 - 22.03.26	400 000	EUR	374 378	382 552	0,04
Vonovia Finance BV 1.625% 20 - 07.04.24	100 000	EUR	99 317	99 347	0,01
Vonovia Finance BV 1.75% 17 - 25.01.27	300 000	EUR	274 146	285 087	0,03
Vonovia Finance BV 1.80% 19 - 29.06.25	300 000	EUR	290 543	290 211	0,03
Wabtec Transportation Netherlands BV 1.25% 21 - 03.12.27	400 000	EUR	355 072	368 576	0,03
Wolters Kluwer NV 0.25% 21 - 30.03.28	400 000	EUR	350 944	358 976	0,03
Wolters Kluwer NV 1.50% 17 - 22.03.27	520 000	EUR	492 035	496 980	0,05
Wolters Kluwer NV 2.50% 14 - 13.05.24	300 000	EUR	303 300	298 275	0,03
Wolters Kluwer NV 3.00% 22 - 23.09.26	650 000	EUR	644 613	651 157	0,06
WPC Eurobond BV 1.35% 19 - 15.04.28	300 000	EUR	259 245	274 512	0,03
WPC Eurobond BV 2.125% 18 - 15.04.27	100 000	EUR	90 726	94 941	0,01
WPC Eurobond BV 2.25% 17 - 19.07.24	400 000	EUR	398 112	395 120	0,04
WPC Eurobond BV 2.25% 18 - 09.04.26	300 000	EUR	288 440	290 343	0,03
			133 726 668	135 373 933	12,83
Nouvelle-Zélande					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.20% 21 - 23.09.27	500 000	EUR	424 247	447 170	0,04
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 1.125% 18 - 20.03.25	400 000	EUR	389 587	388 280	0,04
ASB Bank Ltd. 0.25% 21 - 08.09.28	500 000	EUR	419 078	435 845	0,04
ASB Bank Ltd. 0.75% 19 - 13.03.24	200 000	EUR	197 926	198 710	0,02
ASB Bank Ltd. 4.50% 23 - 16.03.27	400 000	EUR	406 504	412 920	0,04
BNZ International Funding Ltd. 0.375% 19 - 14.09.24	400 000	EUR	387 886	390 304	0,04
Chorus Ltd. 0.875% 19 - 05.12.26	350 000	EUR	324 300	326 599	0,03
Fonterra Co-operative Group Ltd. 0.75% 16 - 08.11.24	300 000	EUR	295 980	292 104	0,03
Westpac Securities NZ Ltd. 0.10% 21 - 13.07.27	420 000	EUR	364 359	375 749	0,03
Westpac Securities NZ Ltd. 0.30% 19 - 25.06.24	300 000	EUR	291 032	294 750	0,03
Westpac Securities NZ Ltd. 0.427% 21 - 14.12.26	500 000	EUR	453 444	459 550	0,04
Westpac Securities NZ Ltd. 1.099% 22 - 24.03.26	400 000	EUR	384 207	379 492	0,04
			4 338 550	4 401 473	0,42
Norvège					
DNB Bank ASA 0.25% 19 - 09.04.24	300 000	EUR	292 968	296 985	0,03
DNB Bank ASA FRN 21 - 23.02.29	500 000	EUR	424 411	438 575	0,04
DNB Bank ASA FRN 22 - 18.01.28	700 000	EUR	640 308	641 410	0,06
DNB Bank ASA FRN 22 - 31.05.26	400 000	EUR	385 940	389 512	0,04
DNB Bank ASA FRN 22 - 21.09.27	890 000	EUR	872 317	887 170	0,08
DNB Bank ASA FRN 23 - 16.02.27	700 000	EUR	692 071	702 205	0,07
DNB Bank ASA FRN 23 - 14.03.29	700 000	EUR	709 107	721 469	0,07
DNB Bank ASA FRN 23 - 19.07.28	700 000	EUR	709 737	723 401	0,07
DNB Bank ASA FRN 22 - 28.02.33	500 000	EUR	491 465	511 965	0,05
DNB Bank ASA FRN 23 - 01.11.29	400 000	EUR	410 352	420 416	0,04
DNB Bank ASA FRN 23 - 13.09.33	300 000	EUR	301 052	312 300	0,03
Norsk Hydro ASA 1.125% 19 - 11.04.25	520 000	EUR	500 242	502 486	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Santander Consumer Bank AS 0.125% 19 - 11.09.24	200 000	EUR	192 610	194 892	0,02
Santander Consumer Bank AS 0.125% 20 - 25.02.25	400 000	EUR	380 429	383 868	0,03
Santander Consumer Bank AS 0.125% 21 - 14.04.26	400 000	EUR	367 922	370 632	0,03
Santander Consumer Bank AS 0.50% 22 - 11.08.25	400 000	EUR	377 436	380 272	0,03
Sparebank 1 Oestlandet 0.125% 21 - 03.03.28	200 000	EUR	170 658	175 750	0,02
Sparebank 1 Oestlandet 0.25% 19 - 30.09.24	300 000	EUR	292 376	291 948	0,03
Sparebank 1 Oestlandet 1.75% 22 - 27.04.27	300 000	EUR	283 738	285 306	0,03
SpareBank 1 SMN 0.01% 21 - 18.02.28	100 000	EUR	84 466	87 826	0,01
SpareBank 1 SMN 0.125% 19 - 11.09.26	500 000	EUR	457 188	460 160	0,04
SpareBank 1 SMN 3.125% 22 - 22.12.25	400 000	EUR	393 614	397 520	0,04
SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.25% 21 - 09.11.26	300 000	EUR	272 207	275 670	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA FRN 21 - 15.07.27	200 000	EUR	183 035	183 280	0,02
SpareBank 1 SR-Bank ASA 0.625% 19 - 25.03.24	500 000	EUR	490 999	496 165	0,05
SpareBank 1 SR-Bank ASA 2.875% 22 - 20.09.25	400 000	EUR	392 766	396 360	0,04
SpareBank 1 SR-Bank ASA 3.75% 23 - 23.11.27	650 000	EUR	647 140	661 434	0,06
SpareBank 1 SR-Bank ASA 4.875% 23 - 24.08.28	300 000	EUR	302 579	315 816	0,03
			11 719 133	11 904 793	1,13
Pologne					
Bank Polska Kasa Opieki SA FRN 23 - 23.11.27	300 000	EUR	306 927	306 189	0,03
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA FRN 23 - 01.02.26	400 000	EUR	401 256	404 696	0,04
			708 183	710 885	0,07
Portugal					
Banco Comercial Portugues SA FRN 21 - 12.02.27	200 000	EUR	181 816	189 064	0,02
Banco Comercial Portugues SA FRN 21 - 07.04.28	200 000	EUR	176 546	186 808	0,01
Banco Comercial Portugues SA FRN 23 - 02.10.26	400 000	EUR	402 956	411 272	0,04
			761 318	787 144	0,07
Roumanie					
Banca Comerciala Romana SA FRN 23 - 19.05.27	500 000	EUR	514 593	527 920	0,05
Raiffeisen Bank SA FRN 23 - 12.10.27	200 000	EUR	201 340	206 260	0,02
			715 933	734 180	0,07
Singapour					
CapitaLand Ascendas REIT 0.75% 21 - 23.06.28	300 000	EUR	252 042	255 852	0,02
			252 042	255 852	0,02
Slovaquie					
Slovenska Sporitelna AS FRN 23 - 04.10.28	100 000	EUR	99 696	103 123	0,01
			99 696	103 123	0,01
Slovénie					
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. FRN 23 - 29.06.26	400 000	EUR	409 834	412 984	0,04
			409 834	412 984	0,04
Espagne					
Abertis Infraestructuras SA 0.625% 19 - 15.07.25	600 000	EUR	567 675	574 578	0,05
Abertis Infraestructuras SA 1.00% 16 - 27.02.27	600 000	EUR	542 263	564 108	0,05
Abertis Infraestructuras SA 1.125% 19 - 26.03.28	700 000	EUR	623 501	641 228	0,06
Abertis Infraestructuras SA 1.25% 20 - 07.02.28	700 000	EUR	621 676	645 337	0,06
Abertis Infraestructuras SA 1.375% 16 - 20.05.26	900 000	EUR	850 268	868 995	0,08
Abertis Infraestructuras SA 2.375% 19 - 27.09.27	900 000	EUR	828 590	876 708	0,08
Abertis Infraestructuras SA 2.50% 14 - 27.02.25	600 000	EUR	596 186	591 750	0,06

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Abertis Infraestructuras SA 4.125% 23 - 31.01.28	600 000	EUR	601 880	617 154	0,06
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 0.375% 21 - 07.10.27	500 000	EUR	437 944	448 095	0,04
ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA 1.875% 18 - 20.04.26	500 000	EUR	472 219	483 940	0,05
Amadeus IT Group SA 1.50% 18 - 18.09.26	500 000	EUR	486 314	485 525	0,05
Amadeus IT Group SA 1.875% 20 - 24.09.28	300 000	EUR	276 058	286 182	0,03
Amadeus IT Group SA 2.50% 20 - 20.05.24	500 000	EUR	504 073	497 080	0,05
Amadeus IT Group SA 2.875% 20 - 20.05.27	600 000	EUR	594 353	594 750	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 21 - 24.03.27	700 000	EUR	642 896	651 819	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 02.10.24	600 000	EUR	579 655	584 862	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 15.11.26	600 000	EUR	546 294	555 630	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.50% 20 - 14.01.27	800 000	EUR	724 531	737 944	0,07
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 20 - 04.06.25	600 000	EUR	580 092	578 286	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 22 - 14.01.29	700 000	EUR	610 090	634 683	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.00% 19 - 21.06.26	700 000	EUR	660 453	664 839	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 20 - 16.01.30	600 000	EUR	555 728	577 080	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.125% 19 - 28.02.24	500 000	EUR	494 068	497 745	0,05
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.375% 18 - 14.05.25	700 000	EUR	678 548	679 049	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.75% 22 - 26.11.25	800 000	EUR	766 772	778 264	0,07
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19 - 22.02.29	600 000	EUR	593 676	597 990	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.375% 22 - 20.09.27	600 000	EUR	581 383	605 676	0,06
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.50% 17 - 10.02.27	700 000	EUR	689 461	700 777	0,07
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 23 - 10.05.26	700 000	EUR	699 979	704 466	0,07
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 23 - 15.09.33	400 000	EUR	396 973	420 676	0,04
Banco de Sabadell SA FRN 19 - 07.11.25	300 000	EUR	283 400	291 549	0,03
Banco de Sabadell SA 0.875% 19 - 22.07.25	700 000	EUR	658 900	673 680	0,06
Banco de Sabadell SA FRN 20 - 11.03.27	300 000	EUR	280 532	284 715	0,03
Banco de Sabadell SA 1.625% 18 - 07.03.24	400 000	EUR	394 098	398 248	0,04
Banco de Sabadell SA FRN 23 - 07.06.29	500 000	EUR	499 427	525 560	0,05
Banco de Sabadell SA FRN 22 - 10.11.28	500 000	EUR	511 155	525 605	0,05
Banco Santander SA 0.20% 21 - 11.02.28	700 000	EUR	599 643	619 066	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Santander SA 0.25% 19 - 19.06.24	500 000	EUR	489 304	491 410	0,05
Banco Santander SA 0.30% 19 - 04.10.26	600 000	EUR	552 136	557 430	0,05
Banco Santander SA 0.50% 20 - 04.02.27	700 000	EUR	626 612	642 278	0,06
Banco Santander SA FRN 21 - 24.03.27	600 000	EUR	542 835	559 950	0,05
Banco Santander SA FRN 21 - 24.06.29	500 000	EUR	426 409	442 685	0,04
Banco Santander SA 1.125% 18 - 17.01.25	900 000	EUR	876 026	875 664	0,08
Banco Santander SA 1.125% 20 - 23.06.27	600 000	EUR	534 799	559 950	0,05
Banco Santander SA 1.375% 20 - 05.01.26	1 100 000	EUR	1 056 833	1 055 065	0,10
Banco Santander SA 2.125% 18 - 08.02.28	1 000 000	EUR	924 683	946 370	0,09
Banco Santander SA 2.50% 15 - 18.03.25	1 000 000	EUR	990 150	986 200	0,09
Banco Santander SA 3.125% 17 - 19.01.27	700 000	EUR	684 288	694 113	0,07
Banco Santander SA 3.25% 16 - 04.04.26	900 000	EUR	890 819	894 357	0,08
Banco Santander SA FRN 22 - 27.09.26	1 000 000	EUR	993 037	1 001 440	0,09
Banco Santander SA 3.75% 23 - 16.01.26	1 200 000	EUR	1 199 536	1 210 164	0,11
Banco Santander SA 3.875% 23 - 16.01.28	900 000	EUR	902 928	921 474	0,09
Banco Santander SA FRN 23 - 18.10.27	800 000	EUR	801 721	819 624	0,08
Banco Santander SA FRN 23 - 23.08.33	1 000 000	EUR	1 003 450	1 048 570	0,10
Bankinter SA 0.625% 20 - 06.10.27	500 000	EUR	430 276	455 080	0,04
Bankinter SA 0.875% 19 - 05.03.24	300 000	EUR	297 240	298 431	0,03
Bankinter SA 0.875% 19 - 08.07.26	400 000	EUR	368 021	376 220	0,04
Bankinter SA FRN 21 - 23.12.32	400 000	EUR	324 961	356 528	0,03
CaixaBank SA 0.375% 20 - 03.02.25	600 000	EUR	575 063	579 312	0,05
CaixaBank SA FRN 20 - 18.11.26	700 000	EUR	642 147	658 819	0,06
CaixaBank SA FRN 21 - 09.02.29	600 000	EUR	508 781	528 858	0,05
CaixaBank SA 0.625% 19 - 01.10.24	700 000	EUR	678 103	683 564	0,06
CaixaBank SA FRN 22 - 21.01.28	600 000	EUR	541 540	553 470	0,05
CaixaBank SA 0.75% 19 - 09.07.26	300 000	EUR	275 686	281 853	0,03
CaixaBank SA FRN 20 - 10.07.26	700 000	EUR	663 956	672 721	0,06
CaixaBank SA FRN 21 - 26.05.28	500 000	EUR	427 903	455 810	0,04
CaixaBank SA 0.875% 19 - 25.03.24	300 000	EUR	294 072	297 882	0,03
CaixaBank SA 1.00% 19 - 25.06.24	300 000	EUR	294 085	295 821	0,03
CaixaBank SA 1.125% 17 - 17.05.24	600 000	EUR	590 426	593 706	0,06
CaixaBank SA 1.125% 19 - 27.03.26	600 000	EUR	571 990	571 386	0,05
CaixaBank SA 1.125% 19 - 12.11.26	400 000	EUR	369 780	375 696	0,03
CaixaBank SA FRN 21 - 18.06.31	500 000	EUR	447 534	465 370	0,04
CaixaBank SA 1.375% 19 - 19.06.26	800 000	EUR	749 850	759 744	0,07
CaixaBank SA FRN 22 - 13.04.26	800 000	EUR	765 354	778 592	0,07
CaixaBank SA FRN 18 - 17.04.30	500 000	EUR	468 451	482 740	0,05
CaixaBank SA 2.375% 19 - 01.02.24	600 000	EUR	598 879	599 292	0,06
CaixaBank SA FRN 19 - 15.02.29	800 000	EUR	796 585	798 984	0,08
CaixaBank SA FRN 23 - 16.05.27	700 000	EUR	701 546	714 553	0,07
CaixaBank SA FRN 23 - 19.07.29	700 000	EUR	708 886	731 878	0,07
CaixaBank SA FRN 22 - 23.02.33	500 000	EUR	505 676	527 575	0,05
FCC Aqualia SA 2.629% 17 - 08.06.27	570 000	EUR	531 925	557 306	0,05
FCC Servicios Medio Ambiente Holdings SAU 1.661% 19 - 04.12.26	500 000	EUR	470 234	476 580	0,04
Ferrovial Emisiones SA 0.54% 20 - 12.11.28	600 000	EUR	521 078	532 056	0,05
Ferrovial Emisiones SA 1.375% 17 - 31.03.25	500 000	EUR	486 672	486 670	0,05

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Ferrovial Emisiones SA 1.382% 20 - 14.05.26	600 000	EUR	580 576	577 866	0,05
Ferrovial Emisiones SA 2.50% 14 - 15.07.24	300 000	EUR	303 745	297 639	0,03
Ibercaja Banco SA FRN 22 - 15.06.25	200 000	EUR	196 839	199 348	0,02
Ibercaja Banco SA FRN 23 - 07.06.27	300 000	EUR	299 969	309 390	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.35% 20 - 14.10.28	300 000	EUR	261 737	276 678	0,03
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.625% 17 - 28.11.25	400 000	EUR	386 671	386 772	0,04
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.00% 18 - 17.04.26	400 000	EUR	379 743	387 088	0,04
Lar Espana Real Estate Socimi SA 1.75% 21 - 22.07.26	200 000	EUR	180 882	179 598	0,02
Mapfre SA 1.625% 16 - 19.05.26	400 000	EUR	388 762	391 308	0,04
Mapfre SA FRN 18 - 07.09.48	300 000	EUR	277 384	289 590	0,03
Mapfre SA FRN 17 - 31.03.47	600 000	EUR	586 327	591 300	0,06
Merlin Properties Socimi SA 1.75% 17 - 26.05.25	400 000	EUR	389 625	388 736	0,04
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 16 - 02.11.26	500 000	EUR	466 607	481 315	0,05
Merlin Properties Socimi SA 2.375% 20 - 13.07.27	300 000	EUR	290 833	288 759	0,03
Red Electrica Corp. SA 0.875% 20 - 14.04.25	500 000	EUR	490 471	483 870	0,05
Red Electrica Corp. SA FRN 23 - 31.12.99	600 000	EUR	598 000	610 734	0,06
Red Electrica Financiaciones SAU 0.375% 20 - 24.07.28	500 000	EUR	442 235	452 220	0,04
Red Electrica Financiaciones SAU 1.00% 16 - 21.04.26	300 000	EUR	287 870	288 123	0,03
Red Electrica Financiaciones SAU 1.125% 15 - 24.04.25	500 000	EUR	490 069	486 280	0,05
Red Electrica Financiaciones SAU 1.25% 18 - 13.03.27	700 000	EUR	664 959	667 793	0,06
Santander Consumer Finance SA Zero Coupon 21 - 23.02.26	400 000	EUR	366 606	373 216	0,03
Santander Consumer Finance SA 0.375% 19 - 27.06.24	600 000	EUR	584 109	589 536	0,06
Santander Consumer Finance SA 0.375% 20 - 17.01.25	700 000	EUR	667 929	676 879	0,06
Santander Consumer Finance SA 0.50% 19 - 14.11.26	200 000	EUR	184 302	184 948	0,02
Santander Consumer Finance SA 0.50% 22 - 14.01.27	600 000	EUR	541 024	551 934	0,05
Santander Consumer Finance SA 1.00% 19 - 27.02.24	600 000	EUR	592 323	597 240	0,06
Santander Consumer Finance SA 4.125% 23 - 05.05.28	300 000	EUR	300 021	309 915	0,03
Telefonica Emisiones SA 1.069% 19 - 05.02.24	800 000	EUR	794 085	797 912	0,08
Telefonica Emisiones SA 1.201% 20 - 21.08.27	1 200 000	EUR	1 094 905	1 119 984	0,11
Telefonica Emisiones SA 1.447% 18 - 22.01.27	1 100 000	EUR	1 046 751	1 049 268	0,10
Telefonica Emisiones SA 1.46% 16 - 13.04.26	1 200 000	EUR	1 173 585	1 158 132	0,11
Telefonica Emisiones SA 1.495% 18 - 11.09.25	900 000	EUR	885 670	874 584	0,08
Telefonica Emisiones SA 1.528% 17 - 17.01.25	1 300 000	EUR	1 285 895	1 271 933	0,12
Telefonica Emisiones SA 1.715% 17 - 12.01.28	1 200 000	EUR	1 123 447	1 135 128	0,11
Telefonica Emisiones SA 2.318% 17 - 17.10.28	600 000	EUR	560 372	578 310	0,05
Unicaja Banco SA FRN 21 - 01.12.26	600 000	EUR	551 954	566 880	0,05

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Unicaja Banco SA FRN 22 - 30.06.25	200 000	EUR	203 113	200 096	0,02
Unicaja Banco SA FRN 23 - 21.02.29	300 000	EUR	293 930	308 043	0,03
			70 346 345	71 495 225	6,77
Suède					
Assa Abloy AB 3.75% 23 - 13.09.26	700 000	EUR	700 961	713 160	0,07
Atlas Copco AB 0.625% 16 - 30.08.26	100 000	EUR	93 367	94 362	0,01
Atlas Copco AB 0.625% 16 - 30.08.26	320 000	EUR	299 068	301 958	0,03
Castellum AB 0.75% 19 - 04.09.26	100 000	EUR	83 904	90 525	0,01
Electrolux AB 4.125% 22 - 05.10.26	510 000	EUR	513 742	517 726	0,05
Electrolux AB 4.50% 23 - 29.09.28	300 000	EUR	300 736	306 942	0,03
EQT AB 2.375% 22 - 06.04.28	400 000	EUR	359 507	377 416	0,03
Essity AB 1.125% 15 - 05.03.25	300 000	EUR	292 391	291 489	0,03
Essity AB 1.125% 17 - 27.03.24	500 000	EUR	496 050	496 700	0,05
Essity AB 1.625% 17 - 30.03.27	700 000	EUR	661 422	670 138	0,06
Molnlycke Holding AB 4.25% 23 - 08.09.28	500 000	EUR	496 934	513 345	0,05
Molnlycke Holdings AB 1.875% 17 - 28.02.25	400 000	EUR	392 395	390 664	0,04
Nordea Bank Abp FRN 21 - 18.08.31	800 000	EUR	708 814	735 264	0,07
Sagax AB 1.125% 20 - 30.01.27	200 000	EUR	176 627	179 878	0,02
Sagax AB 2.25% 19 - 13.03.25	300 000	EUR	289 177	291 795	0,03
Sandvik AB 0.375% 21 - 25.11.28	400 000	EUR	344 941	351 944	0,03
Sandvik AB 2.125% 22 - 07.06.27	620 000	EUR	598 761	601 264	0,06
Sandvik AB 3.00% 14 - 18.06.26	300 000	EUR	304 711	297 099	0,03
Securitas AB 0.25% 21 - 22.02.28	300 000	EUR	252 530	264 342	0,02
Securitas AB 1.125% 17 - 20.02.24	400 000	EUR	396 245	398 328	0,04
Securitas AB 1.25% 18 - 06.03.25	100 000	EUR	96 079	96 811	0,01
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.05% 19 - 01.07.24	600 000	EUR	585 346	588 408	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.375% 20 - 11.02.27	500 000	EUR	447 255	455 740	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.375% 21 - 21.06.28	600 000	EUR	505 282	524 526	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 21 - 03.11.31	400 000	EUR	354 392	364 100	0,03
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.75% 22 - 09.08.27	650 000	EUR	577 817	591 292	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.75% 22 - 11.11.26	700 000	EUR	671 730	672 238	0,06
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.25% 22 - 24.11.25	600 000	EUR	599 419	600 438	0,06
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.75% 23 - 07.02.28	700 000	EUR	689 388	707 714	0,07
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.875% 23 - 09.05.28	600 000	EUR	602 422	614 472	0,06
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.00% 22 - 09.11.26	700 000	EUR	709 753	712 236	0,07
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.125% 23 - 29.06.27	600 000	EUR	602 568	618 012	0,06

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.375% 23 - 06.11.28	400 000	EUR	408 099	414 968	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 23 - 17.08.33	300 000	EUR	298 662	311 850	0,03
SKF AB 1.25% 18 - 17.09.25	500 000	EUR	480 653	482 715	0,04
SKF AB 3.125% 22 - 14.09.28	300 000	EUR	287 503	300 012	0,03
Svenska Handelsbanken AB 0.01% 20 - 02.12.27	500 000	EUR	425 846	442 315	0,04
Svenska Handelsbanken AB 0.05% 19 - 03.09.26	400 000	EUR	364 136	367 896	0,03
Svenska Handelsbanken AB 0.05% 21 - 06.09.28	500 000	EUR	416 400	435 115	0,04
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 19 - 18.06.24	556 000	EUR	539 680	546 226	0,05
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 21 - 03.11.26	700 000	EUR	635 434	643 300	0,06
Svenska Handelsbanken AB 1.00% 20 - 15.04.25	700 000	EUR	685 125	679 203	0,06
Svenska Handelsbanken AB FRN 18 - 05.03.29	600 000	EUR	590 399	597 066	0,06
Svenska Handelsbanken AB FRN 22 - 01.06.33	200 000	EUR	185 141	194 998	0,02
Svenska Handelsbanken AB 3.375% 23 - 17.02.28	500 000	EUR	490 012	504 610	0,05
Svenska Handelsbanken AB 3.75% 22 - 01.11.27	410 000	EUR	419 583	420 680	0,04
Svenska Handelsbanken AB 3.75% 23 - 05.05.26	900 000	EUR	900 823	911 412	0,09
Svenska Handelsbanken AB 3.875% 23 - 10.05.27	500 000	EUR	503 526	510 225	0,05
Swedbank AB 0.20% 21 - 12.01.28	500 000	EUR	422 979	435 890	0,04
Swedbank AB 0.25% 19 - 09.10.24	600 000	EUR	580 588	583 650	0,05
Swedbank AB 0.25% 21 - 02.11.26	600 000	EUR	546 053	553 680	0,05
Swedbank AB FRN 21 - 20.05.27	600 000	EUR	543 514	554 292	0,05
Swedbank AB 0.75% 20 - 05.05.25	600 000	EUR	576 688	578 412	0,05
Swedbank AB 1.30% 22 - 17.02.27	500 000	EUR	467 180	465 465	0,04
Swedbank AB 2.10% 22 - 25.05.27	600 000	EUR	576 462	577 518	0,05
Swedbank AB FRN 22 - 23.08.32	500 000	EUR	471 156	488 785	0,05
Swedbank AB 3.75% 22 - 14.11.25	600 000	EUR	602 239	605 118	0,06
Swedbank AB 4.125% 23 - 13.11.28	500 000	EUR	506 439	518 005	0,05
Swedbank AB 4.25% 23 - 11.07.28	500 000	EUR	503 064	513 690	0,05
Swedbank AB 4.625% 23 - 30.05.26	500 000	EUR	500 039	505 245	0,05
Tele2 AB 2.125% 18 - 15.05.28	500 000	EUR	468 962	478 715	0,04
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.125% 22 - 08.02.27	660 000	EUR	578 513	609 794	0,06
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.875% 17 - 01.03.24	700 000	EUR	693 712	697 277	0,06
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 5.375% 23 - 29.05.28	700 000	EUR	716 834	731 493	0,07
Telia Co. AB FRN 20 - 11.05.81	400 000	EUR	362 684	371 500	0,03
Telia Co. AB FRN 22 - 30.06.83	600 000	EUR	534 026	552 006	0,05
Telia Co. AB 3.00% 12 - 07.09.27	650 000	EUR	639 881	651 781	0,06
Telia Co. AB 3.625% 12 - 14.02.24	500 000	EUR	511 732	499 435	0,05
Telia Co. AB 3.875% 10 - 01.10.25	700 000	EUR	725 516	708 211	0,07
Telia Co. AB FRN 22 - 21.12.82	600 000	EUR	591 431	598 458	0,06
Volvo Treasury AB Zero Coupon 21 - 18.05.26	300 000	EUR	274 982	278 883	0,03
Volvo Treasury AB Zero Coupon 21 - 09.05.24	400 000	EUR	386 839	394 368	0,04
Volvo Treasury AB 0.125% 20 - 17.09.24	400 000	EUR	383 104	389 676	0,04
Volvo Treasury AB 0.625% 22 - 14.02.25	400 000	EUR	383 324	387 124	0,04
Volvo Treasury AB 1.625% 20 - 26.05.25	400 000	EUR	390 481	390 160	0,04

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Volvo Treasury AB 1.625% 22 - 18.09.25	550 000	EUR	535 160	534 418	0,05
Volvo Treasury AB 2.00% 22 - 19.08.27	520 000	EUR	493 035	502 154	0,05
Volvo Treasury AB 2.125% 22 - 01.09.24	600 000	EUR	593 728	592 824	0,06
Volvo Treasury AB 2.625% 22 - 20.02.26	750 000	EUR	731 809	741 240	0,07
Volvo Treasury AB 3.50% 23 - 17.11.25	800 000	EUR	796 231	803 400	0,07
Volvo Treasury AB 3.625% 23 - 25.05.27	600 000	EUR	601 591	610 326	0,06
Volvo Treasury AB 3.75% 23 - 25.11.24	500 000	EUR	499 713	499 785	0,05
Volvo Treasury AB 3.875% 23 - 29.08.26	800 000	EUR	802 947	815 128	0,08
			40 827 392	41 410 823	3,92
Suisse					
Bank Julius Baer & Co. AG Zero Coupon 21 - 25.06.24	200 000	EUR	194 647	195 960	0,02
Credit Suisse AG 0.25% 21 - 05.01.26	850 000	EUR	774 263	797 614	0,08
Credit Suisse AG 0.25% 21 - 01.09.28	600 000	EUR	498 686	521 802	0,05
Credit Suisse AG 0.45% 20 - 19.05.25	200 000	EUR	186 572	191 998	0,02
Credit Suisse AG 1.50% 16 - 10.04.26	1 100 000	EUR	1 041 845	1 053 316	0,10
Credit Suisse AG 2.125% 22 - 31.05.24	400 000	EUR	392 717	396 280	0,04
Credit Suisse AG 5.50% 23 - 20.08.26	600 000	EUR	609 515	630 552	0,06
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 4.84% 23 - 03.11.28	300 000	EUR	308 051	312 915	0,03
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 5.23% 22 - 01.11.27	400 000	EUR	414 713	424 040	0,04
UBS AG 0.01% 21 - 31.03.26	900 000	EUR	838 386	838 332	0,08
UBS AG 0.01% 21 - 29.06.26	400 000	EUR	368 799	370 368	0,03
UBS Group AG FRN 20 - 29.01.26	800 000	EUR	745 804	766 712	0,07
UBS Group AG FRN 20 - 05.11.28	1 100 000	EUR	923 262	967 934	0,09
UBS Group AG 0.25% 21 - 24.02.28	600 000	EUR	512 177	527 766	0,05
UBS Group AG FRN 21 - 03.11.26	700 000	EUR	637 487	656 607	0,06
UBS Group AG FRN 20 - 14.01.28	1 000 000	EUR	848 171	913 910	0,09
UBS Group AG FRN 19 - 24.06.27	900 000	EUR	799 584	844 911	0,08
UBS Group AG FRN 22 - 21.03.25	800 000	EUR	781 007	794 392	0,08
UBS Group AG 1.25% 16 - 01.09.26	700 000	EUR	660 006	665 504	0,06
UBS Group AG FRN 17 - 17.07.25	900 000	EUR	853 373	884 781	0,08
UBS Group AG FRN 18 - 17.04.25	1 200 000	EUR	1 185 820	1 189 392	0,11
UBS Group AG 2.125% 16 - 04.03.24	400 000	EUR	405 820	398 660	0,04
UBS Group AG FRN 22 - 13.10.26	1 380 000	EUR	1 276 074	1 340 767	0,13
UBS Group AG FRN 22 - 15.06.27	800 000	EUR	777 840	783 800	0,07
UBS Group AG FRN 20 - 02.04.26	1 200 000	EUR	1 159 792	1 189 320	0,11
UBS Group AG FRN 23 - 17.03.28	700 000	EUR	705 446	719 936	0,07
UBS Group AG FRN 22 - 01.03.29	1 900 000	EUR	2 080 715	2 189 522	0,21
			19 980 572	20 567 091	1,95
Royaume-Uni					
Aon Global Ltd. 2.875% 14 - 14.05.26	200 000	EUR	194 584	196 720	0,02
AstraZeneca PLC 0.75% 16 - 12.05.24	700 000	EUR	689 610	692 139	0,07
AstraZeneca PLC 1.25% 16 - 12.05.28	600 000	EUR	551 191	564 474	0,05
AstraZeneca PLC 3.625% 23 - 03.03.27	450 000	EUR	451 786	460 355	0,04
AstraZeneca PLC 3.625% 23 - 03.03.27	400 000	EUR	397 846	409 204	0,04
Aviva PLC 1.875% 18 - 13.11.27	200 000	EUR	188 821	195 224	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Aviva PLC FRN 15 - 04.12.45	500 000	EUR	478 160	487 485	0,05
Aviva PLC FRN 14 - 03.07.44	500 000	EUR	491 352	495 680	0,05
Barclays Bank PLC 2.25% 14 - 10.06.24	500 000	EUR	499 266	496 020	0,05
Barclays PLC FRN 21 - 09.08.29	1 000 000	EUR	832 941	860 750	0,08
Barclays PLC FRN 19 - 09.06.25	400 000	EUR	385 395	393 912	0,04
Barclays PLC FRN 22 - 28.01.28	760 000	EUR	675 339	697 672	0,07
Barclays PLC FRN 21 - 22.03.31	700 000	EUR	621 414	644 959	0,06
Barclays PLC FRN 18 - 24.01.26	700 000	EUR	671 204	679 868	0,06
Barclays PLC FRN 22 - 31.01.27	650 000	EUR	629 290	639 139	0,06
Barclays PLC FRN 20 - 02.04.25	1 200 000	EUR	1 209 429	1 196 880	0,11
Brambles Finance PLC 1.50% 17 - 04.10.27	420 000	EUR	384 309	395 753	0,04
British Telecommunications PLC 0.50% 19 - 12.09.25	710 000	EUR	669 763	676 381	0,06
British Telecommunications PLC 1.00% 17 - 23.06.24	400 000	EUR	392 050	394 508	0,04
British Telecommunications PLC 1.00% 17 - 21.11.24	800 000	EUR	775 472	780 136	0,07
British Telecommunications PLC 1.50% 17 - 23.06.27	1 240 000	EUR	1 143 821	1 172 767	0,11
British Telecommunications PLC 1.75% 16 - 10.03.26	1 300 000	EUR	1 275 623	1 260 935	0,12
British Telecommunications PLC 2.125% 18 - 26.09.28	400 000	EUR	368 225	383 376	0,04
British Telecommunications PLC 2.75% 22 - 30.08.27	800 000	EUR	775 180	790 528	0,07
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0.20% 20 - 02.12.28	800 000	EUR	700 736	698 096	0,07
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.125% 16 - 26.05.24	400 000	EUR	394 727	395 596	0,04
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.50% 18 - 08.11.27	750 000	EUR	699 315	708 667	0,07
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.75% 16 - 26.05.28	300 000	EUR	277 908	284 835	0,03
Coca-Cola Europacific Partners PLC 1.75% 20 - 27.03.26	700 000	EUR	680 588	680 554	0,06
Coca-Cola Europacific Partners PLC 2.375% 13 - 07.05.25	400 000	EUR	402 687	394 564	0,04
DS Smith PLC 0.875% 19 - 12.09.26	700 000	EUR	646 689	653 093	0,06
DS Smith PLC 1.375% 17 - 26.07.24	400 000	EUR	393 939	394 048	0,04
DS Smith PLC 4.375% 23 - 27.07.27	900 000	EUR	906 778	926 118	0,09
easyJet PLC 0.875% 19 - 11.06.25	550 000	EUR	517 891	528 638	0,05
Experian Finance PLC 1.375% 17 - 25.06.26	400 000	EUR	380 382	382 536	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.00% 17 - 12.09.26	600 000	EUR	569 619	572 034	0,05
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.25% 18 - 21.05.26	100 000	EUR	95 328	96 211	0,01
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.25% 18 - 21.05.26	1 000 000	EUR	962 059	962 110	0,09
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 14 - 02.12.24	900 000	EUR	887 972	881 658	0,08
GlaxoSmithKline Capital PLC 4.00% 05 - 16.06.25	920 000	EUR	944 239	928 952	0,09
HBOS PLC FRN 05 - 18.03.30	80 000	EUR	78 187	79 733	0,01
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 13.11.26	700 000	EUR	644 845	659 547	0,06
HSBC Holdings PLC FRN 21 - 24.09.29	700 000	EUR	586 612	614 117	0,06
HSBC Holdings PLC 0.875% 16 - 06.09.24	1 300 000	EUR	1 267 360	1 273 792	0,12
HSBC Holdings PLC 2.50% 16 - 15.03.27	800 000	EUR	772 250	784 664	0,07
HSBC Holdings PLC 3.00% 15 - 30.06.25	800 000	EUR	796 420	791 728	0,07
HSBC Holdings PLC FRN 22 - 15.06.27	1 220 000	EUR	1 181 145	1 205 043	0,11

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
HSBC Holdings PLC 3.125% 16 - 07.06.28	600 000	EUR	562 482	589 920	0,06
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 10.03.28	900 000	EUR	914 510	933 444	0,09
HSBC Holdings PLC FRN 22 - 16.11.32	700 000	EUR	725 613	753 235	0,07
Informa PLC 1.25% 19 - 22.04.28	410 000	EUR	366 265	375 474	0,03
Informa PLC 2.125% 20 - 06.10.25	800 000	EUR	773 427	777 344	0,07
InterContinental Hotels Group PLC 1.625% 20 - 08.10.24	300 000	EUR	294 214	294 846	0,03
InterContinental Hotels Group PLC 2.125% 18 - 15.05.27	700 000	EUR	659 079	674 821	0,06
Intermediate Capital Group PLC 1.625% 20 - 17.02.27	200 000	EUR	173 288	184 542	0,02
International Distributions Services PLC 1.25% 19 - 08.10.26	100 000	EUR	92 181	93 394	0,01
International Distributions Services PLC 1.25% 19 - 08.10.26	300 000	EUR	276 468	280 182	0,03
International Distributions Services PLC 2.375% 14 - 29.07.24	400 000	EUR	395 717	395 856	0,04
International Distributions Services PLC 5.25% 23 - 14.09.28	700 000	EUR	706 985	726 516	0,07
Investec Bank PLC FRN 21 - 17.02.27	200 000	EUR	176 954	182 806	0,02
Investec Bank PLC FRN 22 - 11.08.26	100 000	EUR	90 972	93 788	0,01
ITV PLC 1.375% 19 - 26.09.26	700 000	EUR	650 499	658 693	0,06
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 0.375% 20 - 28.01.25	500 000	EUR	479 104	482 645	0,05
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 2.375% 20 - 09.04.26	800 000	EUR	790 411	785 712	0,07
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 4.125% 23 - 30.05.27	600 000	EUR	601 479	614 184	0,06
Lloyds Bank PLC 1.25% 15 - 13.01.25	600 000	EUR	590 264	584 418	0,05
Lloyds Banking Group PLC FRN 19 - 12.11.25	700 000	EUR	665 775	679 826	0,06
Lloyds Banking Group PLC 1.50% 17 - 12.09.27	400 000	EUR	354 982	377 932	0,04
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 01.04.26	100 000	EUR	100 442	99 699	0,01
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 01.04.26	800 000	EUR	811 849	797 592	0,07
Lloyds Banking Group PLC FRN 20 - 18.03.30	200 000	EUR	203 002	199 484	0,02
Lloyds Banking Group PLC FRN 23 - 11.01.29	400 000	EUR	407 185	415 440	0,04
London Stock Exchange Group PLC 0.875% 17 - 19.09.24	300 000	EUR	293 648	293 844	0,03
London Stock Exchange Group PLC 1.75% 18 - 06.12.27	300 000	EUR	279 741	287 307	0,03
Mitsubishi HC Capital UK PLC Zero Coupon 21 - 29.10.24	100 000	EUR	96 021	96 578	0,01
Mitsubishi HC Capital UK PLC 0.25% 22 - 03.02.25	200 000	EUR	191 011	191 662	0,02
Mondi Finance PLC 1.50% 16 - 15.04.24	500 000	EUR	495 330	496 270	0,05
Mondi Finance PLC 1.625% 18 - 27.04.26	600 000	EUR	572 384	579 204	0,05
Motability Operations Group PLC 0.125% 21 - 20.07.28	400 000	EUR	344 590	351 980	0,03
Motability Operations Group PLC 0.375% 19 - 03.01.26	700 000	EUR	659 731	662 172	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Motability Operations Group PLC 0.875% 17 - 14.03.25	620 000	EUR	598 259	601 722	0,06
Nationwide Building Society 0.25% 20 - 22.07.25	730 000	EUR	692 722	694 792	0,07
Nationwide Building Society 0.25% 21 - 14.09.28	400 000	EUR	336 271	349 100	0,03
Nationwide Building Society 1.25% 15 - 03.03.25	600 000	EUR	587 288	583 938	0,05
Nationwide Building Society FRN 18 - 08.03.26	600 000	EUR	576 999	583 956	0,05
Nationwide Building Society FRN 17 - 25.07.29	630 000	EUR	614 834	618 036	0,06
Nationwide Building Society 2.00% 22 - 28.04.27	600 000	EUR	571 190	576 930	0,05
Nationwide Building Society 4.50% 23 - 01.11.26	800 000	EUR	807 093	825 152	0,08
NatWest Group PLC FRN 21 - 14.09.29	600 000	EUR	493 919	521 070	0,05
NatWest Group PLC FRN 19 - 15.11.25	500 000	EUR	477 460	486 190	0,05
NatWest Group PLC FRN 21 - 14.09.32	330 000	EUR	264 657	291 535	0,03
NatWest Group PLC FRN 18 - 02.03.26	800 000	EUR	774 187	778 968	0,07
NatWest Group PLC FRN 18 - 04.03.25	600 000	EUR	594 431	597 750	0,06
NatWest Group PLC FRN 22 - 06.09.28	850 000	EUR	826 893	865 572	0,08
NatWest Group PLC FRN 23 - 14.03.28	400 000	EUR	404 763	411 600	0,04
NatWest Group PLC FRN 23 - 16.02.29	600 000	EUR	601 899	623 946	0,06
NatWest Markets PLC 0.125% 21 - 18.06.26	800 000	EUR	722 851	741 320	0,07
NatWest Markets PLC 0.125% 21 - 12.11.25	880 000	EUR	814 387	829 030	0,08
NatWest Markets PLC 1.00% 19 - 28.05.24	700 000	EUR	691 125	691 873	0,06
NatWest Markets PLC 1.375% 22 - 02.03.27	440 000	EUR	407 723	414 110	0,04
NatWest Markets PLC 2.00% 22 - 27.08.25	500 000	EUR	482 591	487 565	0,05
NatWest Markets PLC 2.75% 20 - 02.04.25	700 000	EUR	699 299	693 525	0,07
NatWest Markets PLC 4.25% 23 - 13.01.28	350 000	EUR	353 179	361 764	0,03
Omnicom Finance Holdings PLC 0.80% 19 - 08.07.27	550 000	EUR	493 249	508 162	0,05
OTE PLC 0.875% 19 - 24.09.26	500 000	EUR	468 380	469 335	0,04
Pearson Funding PLC 1.375% 15 - 06.05.25	300 000	EUR	289 183	289 752	0,03
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 3.625% 23 - 14.09.28	600 000	EUR	593 803	620 490	0,06
Rentokil Initial PLC 0.50% 20 - 14.10.28	700 000	EUR	596 261	620 074	0,06
Rentokil Initial PLC 0.875% 19 - 30.05.26	520 000	EUR	489 700	492 107	0,05
Rentokil Initial PLC 0.95% 17 - 22.11.24	200 000	EUR	195 702	194 688	0,02
Sage Group PLC 3.82% 23 - 15.02.28	500 000	EUR	497 411	514 240	0,05
Santander UK Group Holdings PLC FRN 20 - 28.02.25	400 000	EUR	385 302	397 664	0,04
Santander UK Group Holdings PLC FRN 21 - 13.09.29	400 000	EUR	326 225	344 080	0,03
Santander UK Group Holdings PLC FRN 22 - 25.08.28	450 000	EUR	432 276	446 666	0,04
Santander UK PLC 1.125% 15 - 10.03.25	200 000	EUR	192 141	193 920	0,02
Sky Ltd. 2.25% 15 - 17.11.25	500 000	EUR	486 701	491 565	0,05
Sky Ltd. 2.50% 14 - 15.09.26	1 100 000	EUR	1 072 209	1 083 742	0,10
Smiths Group PLC 2.00% 17 - 23.02.27	600 000	EUR	563 881	581 454	0,05
Standard Chartered PLC FRN 21 - 17.11.29	300 000	EUR	253 906	261 042	0,02
Standard Chartered PLC FRN 20 - 27.01.28	340 000	EUR	300 677	311 464	0,03
Standard Chartered PLC FRN 19 - 02.07.27	300 000	EUR	279 052	280 296	0,03
Standard Chartered PLC FRN 21 - 23.09.31	700 000	EUR	623 133	634 970	0,06
Standard Chartered PLC FRN 17 - 03.10.27	200 000	EUR	184 258	189 588	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Standard Chartered PLC FRN 20 - 09.09.30	600 000	EUR	572 005	580 716	0,05
Standard Chartered PLC 3.125% 14 - 19.11.24	400 000	EUR	400 799	396 436	0,04
Thames Water Utilities Finance PLC 0.875% 22 - 31.01.28	700 000	EUR	601 952	597 786	0,06
Thames Water Utilities Finance PLC 4.00% 23 - 18.04.27	500 000	EUR	498 726	483 910	0,05
Virgin Money UK PLC FRN 20 - 24.06.25	400 000	EUR	397 767	397 564	0,04
Virgin Money UK PLC FRN 23 - 29.10.28	300 000	EUR	295 367	299 283	0,03
Vodafone Group PLC 0.90% 19 - 24.11.26	690 000	EUR	645 610	654 161	0,06
Vodafone Group PLC 1.125% 17 - 20.11.25	1 000 000	EUR	954 040	962 650	0,09
Vodafone Group PLC 1.125% 17 - 20.11.25	100 000	EUR	95 678	96 265	0,01
Vodafone Group PLC 1.50% 17 - 24.07.27	350 000	EUR	329 691	334 037	0,03
Vodafone Group PLC 1.875% 14 - 11.09.25	1 200 000	EUR	1 184 355	1 169 700	0,11
Vodafone Group PLC 2.20% 16 - 25.08.26	1 860 000	EUR	1 835 181	1 824 753	0,17
Wellcome Trust Ltd. 1.125% 15 - 21.01.27	300 000	EUR	283 338	285 699	0,03
WPP Finance 2016 1.375% 18 - 20.03.25	600 000	EUR	580 310	583 296	0,05
Yorkshire Building Society 0.50% 21 - 01.07.28	300 000	EUR	255 117	262 569	0,02
Yorkshire Building Society 0.625% 20 - 21.09.25	300 000	EUR	286 212	284 805	0,03
			75 668 968	76 640 382	7,26
États-Unis					
3M Co. 1.50% 14 - 09.11.26	720 000	EUR	682 823	678 665	0,06
AbbVie Inc. 0.75% 19 - 18.11.27	890 000	EUR	804 070	821 114	0,08
AbbVie Inc. 1.25% 20 - 01.06.24	500 000	EUR	496 053	494 400	0,05
AbbVie Inc. 1.375% 16 - 17.05.24	1 310 000	EUR	1 300 074	1 297 660	0,12
AbbVie Inc. 2.125% 16 - 17.11.28	800 000	EUR	757 126	770 928	0,07
AbbVie Inc. 2.625% 20 - 15.11.28	300 000	EUR	288 791	295 023	0,03
Air Products and Chemicals Inc. 0.50% 20 - 05.05.28	400 000	EUR	353 969	361 296	0,03
Air Products and Chemicals Inc. 1.00% 15 - 12.02.25	400 000	EUR	390 245	390 112	0,04
Alcon Finance BV 2.375% 22 - 31.05.28	400 000	EUR	379 059	386 580	0,04
American Honda Finance Corp. 0.30% 21 - 07.07.28	1 200 000	EUR	1 039 859	1 062 360	0,10
American Honda Finance Corp. 1.95% 20 - 18.10.24	1 100 000	EUR	1 089 457	1 083 599	0,10
American Honda Finance Corp. 3.75% 23 - 25.10.27	790 000	EUR	790 670	810 390	0,08
American International Group Inc. 1.875% 17 - 21.06.27	660 000	EUR	618 097	631 752	0,06
American Tower Corp. 0.40% 21 - 15.02.27	500 000	EUR	441 618	455 655	0,04
American Tower Corp. 0.45% 21 - 15.01.27	800 000	EUR	717 228	731 664	0,07
American Tower Corp. 0.50% 20 - 15.01.28	700 000	EUR	592 571	624 274	0,06
American Tower Corp. 1.375% 17 - 04.04.25	700 000	EUR	679 138	679 483	0,06
American Tower Corp. 1.95% 18 - 22.05.26	400 000	EUR	383 546	385 800	0,04
American Tower Corp. 4.125% 23 - 16.05.27	500 000	EUR	501 592	510 900	0,05
Amgen Inc. 2.00% 16 - 25.02.26	720 000	EUR	711 474	703 166	0,07
Apple Inc. Zero Coupon 19 - 15.11.25	1 100 000	EUR	1 038 689	1 042 954	0,10
Apple Inc. 0.875% 17 - 24.05.25	1 000 000	EUR	978 384	968 920	0,09
Apple Inc. 0.875% 17 - 24.05.25	100 000	EUR	96 456	96 892	0,01
Apple Inc. 1.625% 14 - 10.11.26	1 420 000	EUR	1 389 695	1 379 218	0,13
Apple Inc. 2.00% 15 - 17.09.27	1 000 000	EUR	958 683	978 440	0,09
Apple Inc. 2.00% 15 - 17.09.27	100 000	EUR	95 337	97 844	0,01
AT&T Inc. 0.25% 19 - 04.03.26	1 130 000	EUR	1 036 116	1 060 810	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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. 1.60% 20 - 19.05.28	1 700 000	EUR	1 567 200	1 595 637	0,15
AT&T Inc. 1.80% 18 - 05.09.26	1 420 000	EUR	1 333 411	1 370 783	0,13
AT&T Inc. 2.40% 14 - 15.03.24	1 330 000	EUR	1 318 717	1 325 372	0,13
AT&T Inc. 3.50% 13 - 17.12.25	1 100 000	EUR	1 102 145	1 102 497	0,10
AT&T Inc. 3.55% 23 - 18.11.25	1 000 000	EUR	998 507	1 005 460	0,10
Avery Dennison Corp. 1.25% 17 - 03.03.25	400 000	EUR	387 346	388 108	0,04
Bank of America Corp. FRN 19 - 08.08.29	700 000	EUR	600 586	614 488	0,06
Bank of America Corp. FRN 21 - 24.08.28	630 000	EUR	547 449	567 756	0,05
Bank of America Corp. FRN 19 - 09.05.26	900 000	EUR	853 613	864 954	0,08
Bank of America Corp. 1.375% 15 - 26.03.25	400 000	EUR	390 537	390 032	0,04
Bank of America Corp. FRN 17 - 07.02.25	700 000	EUR	692 995	698 327	0,07
Bank of America Corp. FRN 18 - 25.04.28	800 000	EUR	738 878	756 040	0,07
Bank of America Corp. FRN 17 - 04.05.27	900 000	EUR	862 310	864 657	0,08
Bank of America Corp. FRN 22 - 27.10.26	200 000	EUR	192 668	194 178	0,02
Bank of America Corp. FRN 22 - 27.10.26	920 000	EUR	886 471	893 219	0,08
Bank of America Corp. 2.375% 14 - 19.06.24	800 000	EUR	806 310	793 856	0,07
Bank of America Corp. FRN 20 - 31.03.29	900 000	EUR	888 660	906 066	0,09
Bank of America Corp. 4.134% 23 - 12.06.28	700 000	EUR	698 335	721 889	0,07
Baxter International Inc. 0.40% 19 - 15.05.24	620 000	EUR	601 730	611 748	0,06
Baxter International Inc. 1.30% 17 - 30.05.25	700 000	EUR	682 594	676 410	0,06
Becton Dickinson & Co. 0.034% 21 - 13.08.25	500 000	EUR	469 008	473 485	0,04
Becton Dickinson & Co. 1.90% 16 - 15.12.26	320 000	EUR	304 832	309 178	0,03
Berry Global Inc. 1.00% 20 - 15.01.25	700 000	EUR	663 863	678 517	0,06
Berry Global Inc. 1.50% 20 - 15.01.27	380 000	EUR	329 331	355 608	0,03
BlackRock Inc. 1.25% 15 - 06.05.25	300 000	EUR	294 117	292 629	0,03
BMW US Capital LLC 1.00% 15 - 20.04.27	200 000	EUR	186 297	188 666	0,02
BMW US Capital LLC 1.00% 15 - 20.04.27	430 000	EUR	400 731	405 632	0,04
Booking Holdings Inc. 0.10% 21 - 08.03.25	1 100 000	EUR	1 038 324	1 057 100	0,10
Booking Holdings Inc. 0.50% 21 - 08.03.28	700 000	EUR	619 630	634 690	0,06
Booking Holdings Inc. 1.80% 15 - 03.03.27	900 000	EUR	864 979	866 448	0,08
Booking Holdings Inc. 2.375% 14 - 23.09.24	900 000	EUR	900 990	890 343	0,08
Booking Holdings Inc. 3.625% 23 - 12.11.28	500 000	EUR	506 087	513 740	0,05
Booking Holdings Inc. 4.00% 22 - 15.11.26	900 000	EUR	923 992	924 597	0,09
Boston Scientific Corp. 0.625% 19 - 01.12.27	900 000	EUR	791 926	822 438	0,08
Bristol-Myers Squibb Co. 1.00% 15 - 15.05.25	600 000	EUR	584 811	582 300	0,05
Capital One Financial Corp. 0.80% 19 - 12.06.24	500 000	EUR	484 392	491 530	0,05
Carrier Global Corp. 4.125% 23 - 29.05.28	700 000	EUR	708 431	721 364	0,07
Carrier Global Corp. 4.375% 23 - 29.05.25	700 000	EUR	702 689	706 069	0,07
Caterpillar Financial Services Corp. 3.742% 23 - 04.09.26	900 000	EUR	903 161	917 973	0,09
Chubb INA Holdings Inc. 0.30% 19 - 15.12.24	300 000	EUR	289 751	290 430	0,03
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.06.27	250 000	EUR	221 251	234 117	0,02
Chubb INA Holdings Inc. 1.55% 18 - 15.03.28	700 000	EUR	643 130	660 527	0,06
Citigroup Inc. FRN 19 - 08.10.27	980 000	EUR	881 754	905 618	0,09
Citigroup Inc. FRN 20 - 06.07.26	900 000	EUR	869 334	866 601	0,08
Citigroup Inc. 1.50% 16 - 26.10.28	700 000	EUR	626 543	644 630	0,06
Citigroup Inc. FRN 18 - 24.07.26	1 000 000	EUR	960 476	965 520	0,09
Citigroup Inc. 1.625% 18 - 21.03.28	400 000	EUR	366 415	375 208	0,04

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Citigroup Inc. 1.75% 15 - 28.01.25	820 000	EUR	809 220	802 255	0,08
Citigroup Inc. 2.125% 14 - 10.09.26	500 000	EUR	489 703	481 390	0,05
Citigroup Inc. 2.375% 14 - 22.05.24	900 000	EUR	897 606	894 582	0,08
Citigroup Inc. FRN 22 - 22.09.28	710 000	EUR	695 240	720 387	0,07
Citigroup Inc. FRN 05 - 25.02.30	250 000	EUR	254 172	249 635	0,02
Comcast Corp. Zero Coupon 21 - 14.09.26	1 200 000	EUR	1 075 657	1 106 820	0,10
Comcast Corp. 0.25% 20 - 20.05.27	710 000	EUR	627 875	650 907	0,06
Corning Inc. 3.875% 23 - 15.05.26	400 000	EUR	398 615	404 388	0,04
Danaher Corp. 1.70% 20 - 30.03.24	800 000	EUR	800 886	795 432	0,08
Danaher Corp. 2.10% 20 - 30.09.26	800 000	EUR	781 898	782 160	0,07
Digital Euro Finco LLC 1.125% 19 - 09.04.28	300 000	EUR	257 143	271 500	0,03
Digital Euro Finco LLC 2.50% 19 - 16.01.26	600 000	EUR	578 340	584 184	0,06
Digital Euro Finco LLC 2.625% 16 - 15.04.24	200 000	EUR	199 066	198 836	0,02
Discovery Communications LLC 1.90% 15 - 19.03.27	470 000	EUR	421 963	447 271	0,04
Dover Corp. 0.75% 19 - 04.11.27	500 000	EUR	443 643	457 690	0,04
Dover Corp. 1.25% 16 - 09.11.26	600 000	EUR	568 556	571 566	0,05
DXC Technology Co. 1.75% 18 - 15.01.26	600 000	EUR	574 688	579 216	0,05
Eli Lilly & Co. 1.625% 15 - 02.06.26	700 000	EUR	690 393	680 120	0,06
Equinix Inc. 0.25% 21 - 15.03.27	500 000	EUR	441 239	455 275	0,04
Equitable Financial Life Global Funding 0.60% 21 - 16.06.28	300 000	EUR	257 421	266 760	0,03
FedEx Corp. 0.45% 19 - 05.08.25	500 000	EUR	475 133	478 205	0,05
FedEx Corp. 1.625% 16 - 11.01.27	1 330 000	EUR	1 275 820	1 274 060	0,12
Fidelity National Information Services Inc. 0.625% 19 - 03.12.25	700 000	EUR	662 593	665 259	0,06
Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 19 - 03.12.28	700 000	EUR	634 053	631 624	0,06
Fidelity National Information Services Inc. 1.10% 17 - 15.07.24	520 000	EUR	510 718	511 810	0,05
Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 19 - 21.05.27	1 000 000	EUR	921 408	946 450	0,09
Fiserv Inc. 1.125% 19 - 01.07.27	440 000	EUR	405 710	412 641	0,04
General Electric Co. 0.875% 17 - 17.05.25	700 000	EUR	665 686	676 088	0,06
General Electric Co. 1.875% 15 - 28.05.27	500 000	EUR	469 687	477 685	0,05
General Mills Inc. 0.125% 21 - 15.11.25	300 000	EUR	279 205	283 314	0,03
General Mills Inc. 0.45% 20 - 15.01.26	950 000	EUR	890 192	896 287	0,08
General Mills Inc. 1.50% 15 - 27.04.27	210 000	EUR	195 902	198 576	0,02
General Motors Financial Co. Inc. 0.60% 21 - 20.05.27	700 000	EUR	610 122	639 702	0,06
General Motors Financial Co. Inc. 0.65% 21 - 07.09.28	500 000	EUR	421 547	439 820	0,04
General Motors Financial Co. Inc. 0.85% 20 - 26.02.26	900 000	EUR	829 385	854 271	0,08
General Motors Financial Co. Inc. 1.00% 22 - 24.02.25	600 000	EUR	569 164	581 958	0,05
General Motors Financial Co. Inc. 1.694% 18 - 26.03.25	520 000	EUR	497 601	506 901	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Motors Financial Co. Inc. 2.20% 19 - 01.04.24	800 000	EUR	787 415	796 016	0,08
General Motors Financial Co. Inc. 4.50% 23 - 22.11.27	600 000	EUR	603 754	621 786	0,06
Goldman Sachs Group Inc. 0.125% 19 - 19.08.24	500 000	EUR	479 642	488 365	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 0.25% 21 - 26.01.28	1 200 000	EUR	1 017 914	1 062 660	0,10
Goldman Sachs Group Inc. 1.25% 16 - 01.05.25	920 000	EUR	891 642	891 186	0,08
Goldman Sachs Group Inc. 1.375% 17 - 15.05.24	1 100 000	EUR	1 087 978	1 089 407	0,10
Goldman Sachs Group Inc. 1.625% 16 - 27.07.26	1 340 000	EUR	1 274 052	1 288 075	0,12
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 22.03.28	600 000	EUR	561 694	572 604	0,05
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 01.11.28	1 000 000	EUR	934 194	945 400	0,09
Goldman Sachs Group Inc. 2.125% 14 - 30.09.24	600 000	EUR	594 946	592 050	0,06
Goldman Sachs Group Inc. 2.875% 14 - 03.06.26	330 000	EUR	327 697	327 571	0,03
Goldman Sachs Group Inc. 3.375% 20 - 27.03.25	1 400 000	EUR	1 421 318	1 397 144	0,13
Harley-Davidson Financial Services Inc. 0.90% 19 - 19.11.24	500 000	EUR	485 322	486 075	0,05
Harley-Davidson Financial Services Inc. 5.125% 23 - 05.04.26	800 000	EUR	808 335	825 304	0,08
Illinois Tool Works Inc. 0.25% 19 - 05.12.24	600 000	EUR	579 572	581 364	0,05
Illinois Tool Works Inc. 0.625% 19 - 05.12.27	500 000	EUR	447 147	459 990	0,04
International Business Machines Corp. 0.30% 20 - 11.02.28	1 200 000	EUR	1 043 939	1 081 032	0,10
International Business Machines Corp. 0.875% 19 - 31.01.25	1 100 000	EUR	1 066 751	1 068 221	0,10
International Business Machines Corp. 0.95% 17 - 23.05.25	1 100 000	EUR	1 055 766	1 063 579	0,10
International Business Machines Corp. 1.125% 16 - 06.09.24	500 000	EUR	493 682	491 095	0,05
International Business Machines Corp. 1.25% 19 - 29.01.27	900 000	EUR	857 425	855 045	0,08
International Business Machines Corp. 1.75% 16 - 07.03.28	400 000	EUR	376 307	383 440	0,04
International Business Machines Corp. 2.875% 13 - 07.11.25	1 130 000	EUR	1 141 950	1 123 141	0,11
International Business Machines Corp. 3.375% 23 - 06.02.27	1 100 000	EUR	1 104 180	1 113 222	0,11
International Flavors & Fragrances Inc. 1.75% 16 - 14.03.24	500 000	EUR	494 068	497 425	0,05
International Flavors & Fragrances Inc. 1.80% 18 - 25.09.26	650 000	EUR	607 404	617 441	0,06
Johnson & Johnson 0.65% 16 - 20.05.24	720 000	EUR	708 566	711 454	0,07
Johnson & Johnson 1.15% 16 - 20.11.28	700 000	EUR	647 986	658 707	0,06
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 24.02.28	900 000	EUR	802 552	819 936	0,08
JPMorgan Chase & Co. FRN 19 - 11.03.27	1 300 000	EUR	1 225 652	1 235 026	0,12
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 15 - 27.01.25	900 000	EUR	884 922	877 887	0,08
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 16 - 29.10.26	1 000 000	EUR	951 952	958 130	0,09
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 18.05.28	1 160 000	EUR	1 069 195	1 095 748	0,10
JPMorgan Chase & Co. FRN 18 - 12.06.29	700 000	EUR	634 484	654 689	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
JPMorgan Chase & Co. 2.875% 13 - 24.05.28	700 000	EUR	677 005	689 339	0,07
JPMorgan Chase & Co. 3.00% 14 - 19.02.26	500 000	EUR	503 159	496 545	0,05
Kellanova 1.00% 16 - 17.05.24	400 000	EUR	396 960	395 476	0,04
Kellanova 1.25% 15 - 10.03.25	700 000	EUR	682 098	682 318	0,06
Kimberly-Clark Corp. 0.625% 17 - 07.09.24	300 000	EUR	293 924	293 334	0,03
Kraft Heinz Foods Co. 1.50% 16 - 24.05.24	510 000	EUR	502 310	504 854	0,05
Kraft Heinz Foods Co. 2.25% 16 - 25.05.28	1 300 000	EUR	1 227 480	1 256 515	0,12
Liberty Mutual Group Inc. 2.75% 16 - 04.05.26	600 000	EUR	585 862	590 310	0,06
Linde Inc. 1.20% 16 - 12.02.24	500 000	EUR	498 839	498 445	0,05
Linde Inc. 1.625% 14 - 01.12.25	600 000	EUR	580 824	583 194	0,06
ManpowerGroup Inc. 1.75% 18 - 22.06.26	520 000	EUR	501 035	503 012	0,05
ManpowerGroup Inc. 3.50% 22 - 30.06.27	450 000	EUR	446 712	450 553	0,04
Marsh & McLennan Cos Inc. 1.349% 19 - 21.09.26	400 000	EUR	386 533	383 008	0,04
Mastercard Inc. 2.10% 15 - 01.12.27	800 000	EUR	752 754	778 616	0,07
McDonald's Corp. 0.25% 21 - 04.10.28	400 000	EUR	338 372	352 688	0,03
McDonald's Corp. 0.90% 19 - 15.06.26	600 000	EUR	564 653	570 768	0,05
McDonald's Corp. 1.75% 16 - 03.05.28	800 000	EUR	748 602	759 472	0,07
McDonald's Corp. 1.875% 15 - 26.05.27	600 000	EUR	576 051	576 720	0,05
McDonald's Corp. 2.375% 12 - 27.11.24	400 000	EUR	404 807	395 088	0,04
McDonald's Corp. 2.875% 13 - 17.12.25	300 000	EUR	304 283	299 721	0,03
McDonald's Corp. 3.625% 23 - 28.11.27	500 000	EUR	503 056	510 655	0,05
McKesson Corp. 1.50% 17 - 17.11.25	750 000	EUR	729 963	726 540	0,07
McKesson Corp. 1.625% 18 - 30.10.26	420 000	EUR	402 663	404 422	0,04
Merck & Co. Inc. 0.50% 16 - 02.11.24	400 000	EUR	388 481	389 432	0,04
Merck & Co. Inc. 1.875% 14 - 15.10.26	1 070 000	EUR	1 053 823	1 041 099	0,10
Metropolitan Life Global Funding I 0.375% 19 - 09.04.24	600 000	EUR	584 072	594 324	0,06
Metropolitan Life Global Funding I 0.55% 20 - 16.06.27	430 000	EUR	383 232	394 783	0,04
Metropolitan Life Global Funding I 1.75% 22 - 25.05.25	200 000	EUR	195 036	195 248	0,02
Metropolitan Life Global Funding I 4.00% 23 - 05.04.28	400 000	EUR	401 128	412 864	0,04
Microsoft Corp. 3.125% 13 - 06.12.28	1 700 000	EUR	1 754 196	1 751 068	0,17
MMS USA Holdings Inc. 0.625% 19 - 13.06.25	800 000	EUR	766 465	766 544	0,07
MMS USA Holdings Inc. 1.25% 19 - 13.06.28	700 000	EUR	624 943	646 583	0,06
Moody's Corp. 1.75% 15 - 09.03.27	400 000	EUR	380 101	385 384	0,04
Morgan Stanley FRN 21 - 29.10.27	1 100 000	EUR	992 763	1 010 086	0,10
Morgan Stanley FRN 20 - 26.10.29	1 000 000	EUR	827 646	863 320	0,08
Morgan Stanley FRN 17 - 23.10.26	600 000	EUR	570 449	575 838	0,05
Morgan Stanley 1.375% 16 - 27.10.26	900 000	EUR	849 838	854 883	0,08
Morgan Stanley 1.75% 15 - 30.01.25	900 000	EUR	886 472	881 622	0,08
Morgan Stanley 1.75% 16 - 11.03.24	900 000	EUR	900 015	896 139	0,08
Morgan Stanley 1.875% 17 - 27.04.27	1 370 000	EUR	1 299 977	1 307 213	0,12
Morgan Stanley FRN 22 - 08.05.26	884 000	EUR	857 917	863 915	0,08
Morgan Stanley FRN 23 - 02.03.29	1 400 000	EUR	1 426 083	1 453 564	0,14
Morgan Stanley FRN 22 - 25.10.28	600 000	EUR	616 752	627 924	0,06
New York Life Global Funding 0.25% 20 - 23.01.27	700 000	EUR	631 153	647 794	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
New York Life Global Funding 0.25% 21 - 04.10.28	300 000	EUR	257 953	265 650	0,02
Oracle Corp. 3.125% 13 - 10.07.25	720 000	EUR	731 313	718 531	0,07
Parker-Hannifin Corp. 1.125% 17 - 01.03.25	710 000	EUR	687 531	688 508	0,06
Pfizer Inc. 1.00% 17 - 06.03.27	720 000	EUR	679 465	681 926	0,06
PPG Industries Inc. 0.875% 16 - 03.11.25	600 000	EUR	568 150	573 330	0,05
PPG Industries Inc. 1.40% 15 - 13.03.27	500 000	EUR	465 450	471 550	0,04
PPG Industries Inc. 1.875% 22 - 01.06.25	400 000	EUR	387 920	390 772	0,04
Prologis Euro Finance LLC 0.25% 19 - 10.09.27	400 000	EUR	337 151	359 956	0,03
Prologis Euro Finance LLC 0.375% 20 - 06.02.28	300 000	EUR	258 300	267 453	0,03
Prologis LP 3.00% 14 - 02.06.26	200 000	EUR	204 642	197 600	0,02
PVH Corp. 3.125% 17 - 15.12.27	700 000	EUR	660 586	685 489	0,06
PVH Corp. 3.625% 16 - 15.07.24	400 000	EUR	403 036	398 596	0,04
RELX Capital Inc. 1.30% 15 - 12.05.25	100 000	EUR	96 804	97 164	0,01
RELX Capital Inc. 1.30% 15 - 12.05.25	530 000	EUR	519 675	514 969	0,05
Revvity Inc. 1.875% 16 - 19.07.26	620 000	EUR	595 405	597 277	0,06
Stryker Corp. 0.25% 19 - 03.12.24	900 000	EUR	859 721	871 290	0,08
Stryker Corp. 2.125% 18 - 30.11.27	700 000	EUR	667 707	677 453	0,06
Stryker Corp. 3.375% 23 - 11.12.28	700 000	EUR	712 425	710 696	0,07
Tapestry Inc. 5.35% 23 - 27.11.25	600 000	EUR	608 261	612 228	0,06
Tapestry Inc. 5.375% 23 - 27.11.27	600 000	EUR	610 819	621 522	0,06
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.125% 19 - 01.03.25	800 000	EUR	764 762	769 304	0,07
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.50% 19 - 01.03.28	700 000	EUR	626 947	636 349	0,06
Thermo Fisher Scientific Inc. 0.75% 16 - 12.09.24	830 000	EUR	805 917	812 321	0,08
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.375% 16 - 12.09.28	600 000	EUR	540 700	560 574	0,05
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.40% 17 - 23.01.26	740 000	EUR	718 680	714 041	0,07
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.45% 17 - 16.03.27	520 000	EUR	494 544	496 855	0,05
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.75% 20 - 15.04.27	600 000	EUR	578 011	578 688	0,05
Thermo Fisher Scientific Inc. 2.00% 14 - 15.04.25	700 000	EUR	700 049	685 692	0,06
Thermo Fisher Scientific Inc. 3.20% 22 - 21.01.26	600 000	EUR	598 645	601 302	0,06
United Parcel Service Inc. 1.00% 16 - 15.11.28	400 000	EUR	358 717	368 372	0,03
United Parcel Service Inc. 1.625% 15 - 15.11.25	800 000	EUR	782 482	778 744	0,07
US Bancorp 0.85% 17 - 07.06.24	700 000	EUR	684 044	689 388	0,07
Verizon Communications Inc. 0.875% 16 - 02.04.25	1 100 000	EUR	1 066 552	1 065 515	0,10
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 08.04.27	1 259 000	EUR	1 158 506	1 176 762	0,11
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 08.04.27	100 000	EUR	90 847	93 468	0,01
Verizon Communications Inc. 1.375% 16 - 02.11.28	1 000 000	EUR	903 647	926 570	0,09
Verizon Communications Inc. 1.375% 17 - 27.10.26	1 020 000	EUR	978 034	975 875	0,09
Verizon Communications Inc. 1.375% 17 - 27.10.26	300 000	EUR	280 789	287 022	0,03
Verizon Communications Inc. 1.625% 14 - 01.03.24	600 000	EUR	593 790	597 660	0,06
Verizon Communications Inc. 3.25% 14 - 17.02.26	1 300 000	EUR	1 343 353	1 304 368	0,12
VF Corp. 0.25% 20 - 25.02.28	400 000	EUR	340 884	336 184	0,03
VF Corp. 4.125% 23 - 07.03.26	500 000	EUR	499 067	494 630	0,05
Visa Inc. 1.50% 22 - 15.06.26	1 200 000	EUR	1 152 143	1 159 536	0,11
Walmart Inc. 2.55% 14 - 08.04.26	500 000	EUR	512 777	495 965	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Zimmer Biomet Holdings Inc. 1.164% 19 - 15.11.27	300 000	EUR	271 490	278 025	0,03
Zimmer Biomet Holdings Inc. 2.425% 16 - 13.12.26	600 000	EUR	573 422	588 486	0,06
			157 073 780	158 656 450	15,03
Total - Obligations			1 029 773 071	1 044 223 344	98,94
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	184	EUR	1 845 371	1 849 131	0,18
			1 845 371	1 849 131	0,18
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			1 845 371	1 849 131	0,18
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 031 618 442	1 046 072 475	99,12
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 031 618 442	1 046 072 475	99,12
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 056 477 424	100,10

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

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 - 21.11.25	159 000	AUD	96 047	92 060	0,15
Australia 0.50% 20 - 21.09.26	214 000	AUD	125 842	121 604	0,19
Australia 1.00% 20 - 21.12.30	173 000	AUD	93 015	88 667	0,14
Australia 1.00% 20 - 21.11.31	242 000	AUD	126 996	120 498	0,19
Australia 1.25% 20 - 21.05.32	240 000	AUD	127 185	120 303	0,19
Australia 1.50% 19 - 21.06.31	199 000	AUD	110 190	104 329	0,17
Australia 1.75% 20 - 21.06.51	157 000	AUD	64 719	57 319	0,09
Australia 1.75% 21 - 21.11.32	208 000	AUD	111 938	107 580	0,17
Australia 2.25% 16 - 21.05.28	125 000	AUD	74 990	72 923	0,12
Australia 2.50% 18 - 21.05.30	190 000	AUD	112 880	109 011	0,17
Australia 2.75% 15 - 21.06.35	119 000	AUD	65 414	64 993	0,10
Australia 2.75% 16 - 21.11.27	142 000	AUD	89 282	84 967	0,14
Australia 2.75% 17 - 21.11.28	119 000	AUD	72 762	70 579	0,11
Australia 2.75% 18 - 21.11.29	160 000	AUD	98 883	93 750	0,15
Australia 2.75% 18 - 21.05.41	122 000	AUD	65 955	61 523	0,10
Australia 3.00% 16 - 21.03.47	110 000	AUD	58 682	54 914	0,09
Australia 3.00% 22 - 21.11.33	175 000	AUD	106 630	99 604	0,16
Australia 3.25% 12 - 21.04.29	164 000	AUD	103 617	99 196	0,16
Australia 3.25% 13 - 21.04.25	150 000	AUD	93 916	91 923	0,15
Australia 3.25% 15 - 21.06.39	83 000	AUD	51 185	45 896	0,07
Australia 3.50% 23 - 21.12.34	151 000	AUD	88 468	89 186	0,14
Australia 3.75% 14 - 21.04.37	101 000	AUD	62 267	60 249	0,10
Australia 3.75% 22 - 21.05.34	147 000	AUD	91 773	89 021	0,14
Australia 4.25% 14 - 21.04.26	158 000	AUD	100 869	98 857	0,16
Australia 4.50% 13 - 21.04.33	199 000	AUD	135 899	128 106	0,21
Australia 4.75% 11 - 21.04.27	172 000	AUD	113 768	109 964	0,18
Australia 4.75% 23 - 21.06.54	70 000	AUD	40 185	46 588	0,07
			2 483 357	2 383 610	3,81
Autriche					
Austria 6.25% 97 - 15.07.27	61 000	EUR	69 666	68 949	0,11
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.02.30	75 000	EUR	65 580	64 717	0,10
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.10.40	40 000	EUR	28 786	24 856	0,04
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.02.31	87 000	EUR	74 197	72 941	0,12
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.04.25	50 000	EUR	48 462	48 200	0,08
Austria 144A Zero Coupon 22 - 20.10.28	62 000	EUR	57 349	55 450	0,09
Austria 144A 0.25% 21 - 20.10.36	38 000	EUR	30 704	27 710	0,04
Austria 144A 0.50% 17 - 20.04.27	105 000	EUR	100 003	98 962	0,16
Austria 144A 0.50% 19 - 20.02.29	78 000	EUR	71 647	71 113	0,11
Austria 144A 0.70% 21 - 20.04.71	15 000	EUR	11 491	6 958	0,01
Austria 144A 0.75% 16 - 20.10.26	86 000	EUR	83 508	82 217	0,13
Austria 144A 0.75% 18 - 20.02.28	77 000	EUR	72 477	72 249	0,12
Austria 144A 0.75% 20 - 20.03.51	62 000	EUR	43 085	37 491	0,06
Austria 144A 0.85% 20 - 30.06.20	30 000	EUR	15 946	13 953	0,02
Austria 144A 0.90% 22 - 20.02.32	78 000	EUR	68 754	68 461	0,11
Austria 144A 1.20% 15 - 20.10.25	79 000	EUR	77 828	77 143	0,12
Austria 144A 1.50% 16 - 20.02.47	59 000	EUR	51 809	44 946	0,07
Austria 144A 1.50% 16 - 02.11.86	15 000	EUR	10 433	9 189	0,02
Austria 144A 1.85% 22 - 23.05.49	38 000	EUR	30 523	30 807	0,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 2.00% 22 - 15.07.26	28 000	EUR	27 670	27 731	0,05
Austria 144A 2.10% 17 - 20.09.17	42 000	EUR	37 353	33 268	0,05
Austria 144A 2.40% 13 - 23.05.34	58 000	EUR	58 037	56 608	0,09
Austria 144A 2.90% 23 - 20.02.33	86 000	EUR	85 254	88 004	0,14
Austria 144A 2.90% 23 - 23.05.29	28 000	EUR	28 076	28 795	0,05
Austria 144A 3.15% 12 - 20.06.44	55 000	EUR	58 017	56 969	0,09
Austria 144A 3.15% 23 - 20.10.53	23 000	EUR	22 125	23 987	0,04
Austria 144A 3.45% 23 - 20.10.30	30 000	EUR	31 047	31 782	0,05
Austria 144A 3.80% 12 - 26.01.62	29 000	EUR	35 806	34 374	0,06
Austria 144A 4.15% 07 - 15.03.37	100 000	EUR	117 564	113 968	0,18
Austria 144A 4.85% 09 - 15.03.26	74 000	EUR	77 983	77 626	0,12
			1 591 180	1 549 424	2,48
Belgique					
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	22 000	EUR	25 147	24 306	0,04
Belgium 4.00% 12 - 28.03.32	25 000	EUR	27 282	27 762	0,04
Belgium 5.50% 98 - 28.03.28	39 000	EUR	44 350	44 067	0,07
Belgium 144A Zero Coupon 20 - 22.10.27	23 000	EUR	21 385	21 148	0,03
Belgium 144A Zero Coupon 21 - 22.10.31	29 000	EUR	25 647	23 968	0,04
Belgium 144A 0.10% 20 - 22.06.30	48 000	EUR	40 784	41 592	0,07
Belgium 144A 0.35% 22 - 22.06.32	27 000	EUR	24 854	22 550	0,04
Belgium 144A 0.40% 20 - 22.06.40	15 000	EUR	12 481	9 989	0,02
Belgium 144A 0.65% 21 - 22.06.71	14 000	EUR	7 300	6 222	0,01
Belgium 144A 0.80% 15 - 22.06.25	52 000	EUR	51 670	50 586	0,08
Belgium 144A 0.80% 17 - 22.06.27	26 000	EUR	24 789	24 747	0,04
Belgium 144A 0.80% 18 - 22.06.28	36 000	EUR	34 895	33 841	0,05
Belgium 144A 0.90% 19 - 22.06.29	39 000	EUR	36 792	36 247	0,06
Belgium 144A 1.00% 15 - 22.06.31	36 000	EUR	32 116	32 501	0,05
Belgium 144A 1.00% 16 - 22.06.26	31 000	EUR	30 885	29 992	0,05
Belgium 144A 1.25% 18 - 22.04.33	41 000	EUR	34 669	36 658	0,06
Belgium 144A 1.40% 22 - 22.06.53	23 000	EUR	16 063	15 405	0,02
Belgium 144A 1.45% 17 - 22.06.37	11 000	EUR	10 583	9 280	0,01
Belgium 144A 1.60% 16 - 22.06.47	27 000	EUR	22 018	20 301	0,03
Belgium 144A 1.70% 19 - 22.06.50	25 000	EUR	20 575	18 611	0,03
Belgium 144A 1.90% 15 - 22.06.38	23 000	EUR	20 608	20 277	0,03
Belgium 144A 2.15% 16 - 22.06.66	20 000	EUR	16 278	15 744	0,03
Belgium 144A 2.25% 17 - 22.06.57	11 000	EUR	9 489	9 008	0,01
Belgium 144A 2.75% 22 - 22.04.39	8 000	EUR	7 689	7 804	0,01
Belgium 144A 3.00% 14 - 22.06.34	16 000	EUR	17 147	16 454	0,03
Belgium 144A 3.00% 23 - 22.06.33	33 000	EUR	32 772	34 056	0,05
Belgium 144A 3.30% 23 - 22.06.54	24 000	EUR	22 685	24 463	0,04
Belgium 144A 3.45% 23 - 22.06.43	6 000	EUR	6 056	6 323	0,01
Belgium 144A 4.25% 10 - 28.03.41	41 000	EUR	47 535	47 867	0,08
Belgium 144A 4.50% 11 - 28.03.26	22 000	EUR	22 917	22 961	0,04
Belgium 144A 5.00% 04 - 28.03.35	56 000	EUR	66 841	68 079	0,11
			814 302	802 809	1,28
Canada					
Canada 0.25% 20 - 01.03.26	122 000	CAD	79 611	77 914	0,12
Canada 0.50% 20 - 01.09.25	185 000	CAD	128 138	120 063	0,19

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.50% 20 - 01.12.30	237 000	CAD	137 343	136 802	0,22
Canada 1.00% 16 - 01.06.27	57 000	CAD	38 385	36 287	0,06
Canada 1.00% 21 - 01.09.26	128 000	CAD	86 539	82 398	0,13
Canada 1.25% 19 - 01.03.25	62 000	CAD	41 051	41 105	0,07
Canada 1.25% 21 - 01.03.27	121 000	CAD	79 308	77 757	0,12
Canada 1.50% 15 - 01.06.26	37 000	CAD	25 242	24 195	0,04
Canada 1.50% 19 - 01.06.30	223 000	CAD	141 390	136 870	0,22
Canada 1.50% 21 - 01.06.31	246 000	CAD	156 703	151 004	0,24
Canada 1.50% 21 - 01.12.31	222 000	CAD	136 501	135 327	0,22
Canada 1.50% 22 - 01.04.25	65 000	CAD	48 167	43 117	0,07
Canada 1.75% 21 - 01.12.53	229 000	CAD	117 624	117 816	0,19
Canada 2.00% 17 - 01.06.28	43 000	CAD	28 976	28 153	0,05
Canada 2.00% 17 - 01.12.51	276 000	CAD	158 924	152 610	0,24
Canada 2.00% 22 - 01.06.32	155 000	CAD	103 089	97 785	0,16
Canada 2.25% 14 - 01.06.25	88 000	CAD	59 926	58 896	0,09
Canada 2.25% 18 - 01.06.29	35 000	CAD	24 263	23 081	0,04
Canada 2.25% 22 - 01.12.29	26 000	CAD	17 061	17 103	0,03
Canada 2.50% 14 - 01.12.48	67 000	CAD	39 700	43 668	0,07
Canada 2.50% 22 - 01.12.32	157 000	CAD	103 958	102 775	0,16
Canada 2.75% 14 - 01.12.64	41 000	CAD	28 327	26 719	0,04
Canada 2.75% 22 - 01.09.27	104 000	CAD	72 262	69 989	0,11
Canada 2.75% 23 - 01.12.55	86 000	CAD	53 829	55 675	0,09
Canada 2.75% 23 - 01.06.33	123 000	CAD	81 389	82 084	0,13
Canada 3.00% 22 - 01.10.25	48 000	CAD	35 498	32 432	0,05
Canada 3.00% 23 - 01.04.26	97 000	CAD	65 190	65 633	0,11
Canada 3.25% 23 - 01.09.28	141 000	CAD	94 576	97 139	0,16
Canada 3.25% 23 - 01.12.33	118 000	CAD	76 110	81 990	0,13
Canada 3.50% 11 - 01.12.45	76 000	CAD	57 548	55 697	0,09
Canada 3.50% 22 - 01.03.28	97 000	CAD	68 036	67 262	0,11
Canada 3.50% 23 - 01.08.25	116 000	CAD	78 913	78 962	0,13
Canada 3.75% 22 - 01.02.25	87 000	CAD	60 763	59 280	0,09
Canada 3.75% 23 - 01.05.25	164 000	CAD	110 716	111 889	0,18
Canada 4.00% 08 - 01.06.41	50 000	CAD	40 383	38 375	0,06
Canada 4.00% 23 - 01.03.29	100 000	CAD	69 711	69 382	0,11
Canada 4.50% 23 - 01.11.25	135 000	CAD	91 800	93 666	0,15
Canada 4.50% 23 - 01.02.26	93 000	CAD	63 936	64 839	0,10
Canada 5.00% 04 - 01.06.37	30 000	CAD	25 094	24 824	0,04
Canada 5.75% 98 - 01.06.29	50 000	CAD	40 007	38 837	0,06
Canada 5.75% 01 - 01.06.33	69 000	CAD	56 565	57 391	0,09
			3 022 552	2 976 791	4,76
Danemark					
Denmark Zero Coupon 21 - 15.11.31	679 000	DKK	78 313	77 054	0,12
Denmark 0.25% 20 - 15.11.52	538 000	DKK	47 485	40 997	0,07
Denmark 0.50% 17 - 15.11.27	606 000	DKK	77 624	76 537	0,12
Denmark 0.50% 19 - 15.11.29	427 000	DKK	52 886	52 315	0,08
Denmark 1.75% 14 - 15.11.25	543 000	DKK	72 233	71 894	0,12

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Danemark (suite)					
Denmark 2.25% 23 - 15.11.33	256 000	DKK	32 705	34 242	0,06
Denmark 4.50% 08 - 15.11.39	996 000	DKK	175 623	170 420	0,27
			536 869	523 459	0,84
Finlande					
Finland 144A Zero Coupon 20 - 15.09.30	30 000	EUR	26 946	25 580	0,04
Finland 144A Zero Coupon 21 - 15.09.26	18 000	EUR	17 771	16 877	0,03
Finland 144A 0.125% 20 - 15.04.36	34 000	EUR	24 406	24 809	0,04
Finland 144A 0.125% 21 - 15.04.52	25 000	EUR	15 183	12 279	0,02
Finland 144A 0.125% 21 - 15.09.31	48 000	EUR	40 649	40 153	0,06
Finland 144A 0.25% 20 - 15.09.40	14 000	EUR	11 248	9 269	0,02
Finland 144A 0.50% 16 - 15.04.26	29 000	EUR	28 329	27 749	0,04
Finland 144A 0.50% 17 - 15.09.27	28 000	EUR	26 868	26 262	0,04
Finland 144A 0.50% 18 - 15.09.28	32 000	EUR	29 611	29 394	0,05
Finland 144A 0.50% 19 - 15.09.29	37 000	EUR	34 187	33 416	0,05
Finland 144A 0.50% 22 - 15.04.43	18 000	EUR	13 551	11 755	0,02
Finland 144A 0.75% 15 - 15.04.31	26 000	EUR	23 887	23 125	0,04
Finland 144A 0.875% 15 - 15.09.25	35 000	EUR	34 048	34 005	0,05
Finland 144A 1.125% 18 - 15.04.34	31 000	EUR	26 747	26 897	0,04
Finland 144A 1.375% 17 - 15.04.47	31 000	EUR	24 380	23 492	0,04
Finland 144A 1.375% 22 - 15.04.27	27 000	EUR	25 905	26 166	0,04
Finland 144A 1.50% 22 - 15.09.32	33 000	EUR	30 187	30 383	0,05
Finland 144A 2.625% 12 - 04.07.42	43 000	EUR	43 680	41 777	0,07
Finland 144A 2.75% 12 - 04.07.28	35 000	EUR	36 049	35 660	0,06
Finland 144A 2.75% 23 - 15.04.38	19 000	EUR	17 848	18 897	0,03
Finland 144A 2.875% 23 - 15.04.29	15 000	EUR	14 995	15 392	0,02
Finland 144A 3.00% 23 - 15.09.33	28 000	EUR	27 931	28 978	0,05
Finland 144A 4.00% 09 - 04.07.25	35 000	EUR	36 191	35 620	0,06
			610 597	597 935	0,96
France					
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	233 000	EUR	226 895	225 031	0,36
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	252 000	EUR	223 787	220 954	0,35
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	225 000	EUR	218 245	213 930	0,34
France OAT Zero Coupon 20 - 25.11.30	302 000	EUR	262 320	258 089	0,41
France OAT Zero Coupon 21 - 25.11.31	283 000	EUR	239 662	234 862	0,38
France OAT Zero Coupon 21 - 25.02.27	211 000	EUR	199 561	196 673	0,31
France OAT Zero Coupon 22 - 25.05.32	202 000	EUR	167 525	165 095	0,26
France OAT Zero Coupon 22 - 25.02.25	190 000	EUR	184 738	183 825	0,29
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	193 000	EUR	185 349	182 211	0,29
France OAT 0.50% 15 - 25.05.25	205 000	EUR	200 851	198 911	0,32
France OAT 0.50% 16 - 25.05.26	279 000	EUR	267 734	267 059	0,43
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	304 000	EUR	280 999	277 400	0,44
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	339 000	EUR	320 821	318 253	0,51
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	296 000	EUR	278 355	275 902	0,44
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	180 000	EUR	115 401	103 104	0,17
France OAT 0.75% 22 - 25.02.28	270 000	EUR	251 538	254 313	0,41
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	223 000	EUR	218 537	217 001	0,35
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	205 000	EUR	196 418	196 698	0,32
France OAT 1.25% 18 - 25.05.34	220 000	EUR	196 225	193 138	0,31

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.25% 22 - 25.05.38	61 000	EUR	47 945	49 611	0,08
France OAT 1.50% 15 - 25.05.31	322 000	EUR	306 084	303 807	0,49
France OAT 2.00% 22 - 25.11.32	245 000	EUR	229 962	235 739	0,38
France OAT 2.50% 14 - 25.05.30	328 000	EUR	336 864	332 002	0,53
France OAT 2.50% 23 - 24.09.26	265 000	EUR	262 541	266 007	0,43
France OAT 2.75% 12 - 25.10.27	316 000	EUR	326 786	321 720	0,52
France OAT 2.75% 23 - 25.02.29	175 000	EUR	174 935	179 130	0,29
France OAT 3.00% 23 - 25.05.33	176 000	EUR	175 803	182 970	0,29
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	164 000	EUR	177 779	171 068	0,27
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	225 000	EUR	232 706	230 557	0,37
France OAT 3.50% 23 - 25.11.33	90 000	EUR	93 555	97 263	0,16
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	143 000	EUR	169 576	163 420	0,26
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	106 000	EUR	139 581	126 744	0,20
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	196 000	EUR	243 938	238 904	0,38
France OAT 4.75% 04 - 25.04.35	156 000	EUR	196 929	187 606	0,30
France OAT 5.50% 98 - 25.04.29	183 000	EUR	215 937	211 914	0,34
France OAT 5.75% 01 - 25.10.32	176 000	EUR	224 518	220 968	0,35
France OAT 6.00% 94 - 25.10.25	167 000	EUR	179 134	177 137	0,28
France OAT 144A 0.50% 20 - 25.05.40	138 000	EUR	107 865	95 510	0,15
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.05.72	46 000	EUR	23 163	19 095	0,03
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.06.44	119 000	EUR	81 422	74 518	0,12
France OAT 144A 0.75% 21 - 25.05.53	159 000	EUR	93 542	89 215	0,14
France OAT 144A 1.25% 16 - 25.05.36	273 000	EUR	237 778	230 794	0,37
France OAT 144A 1.50% 19 - 25.05.50	181 000	EUR	148 114	131 442	0,21
France OAT 144A 1.75% 16 - 25.05.66	101 000	EUR	75 168	71 963	0,12
France OAT 144A 1.75% 17 - 25.06.39	188 000	EUR	169 368	163 353	0,26
France OAT 144A 2.00% 17 - 25.05.48	156 000	EUR	133 470	128 996	0,21
France OAT 144A 2.50% 22 - 25.05.43	63 000	EUR	55 925	58 590	0,09
France OAT 144A 3.00% 23 - 25.05.54	116 000	EUR	106 389	113 831	0,18
France OAT 144A 4.00% 05 - 25.04.55	107 000	EUR	137 606	126 249	0,20
			9 339 344	9 182 572	14,69
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	254 000	EUR	242 717	240 355	0,38
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	190 000	EUR	173 062	171 105	0,27
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	278 000	EUR	165 459	154 868	0,25
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	175 553	EUR	156 173	156 356	0,25
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	162 000	EUR	158 116	156 500	0,25
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	161 000	EUR	136 579	126 715	0,20
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	153 000	EUR	142 850	141 837	0,23
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	257 477	EUR	229 137	227 432	0,36

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 20 - 10.10.25	191 000	EUR	184 833	183 100	0,29
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	62 000	EUR	56 414	54 682	0,09
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	67 000	EUR	64 680	64 327	0,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.02.31	222 000	EUR	197 687	194 030	0,31
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	165 000	EUR	159 273	156 948	0,25
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.05.36	172 000	EUR	138 543	131 781	0,21
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.11.28	173 000	EUR	159 508	157 800	0,25
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	75 000	EUR	50 292	41 967	0,07
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	209 000	EUR	184 196	180 762	0,29
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	199 000	EUR	190 027	187 677	0,30
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	200 000	EUR	116 722	106 586	0,17
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	54 000	EUR	48 200	46 661	0,08
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.02.32	229 000	EUR	197 968	195 747	0,31
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 16.04.27	177 000	EUR	166 171	165 702	0,27
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.10.27	210 000	EUR	203 771	204 947	0,33
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	222 000	EUR	215 069	210 072	0,34
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	209 000	EUR	200 420	193 908	0,31
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	221 000	EUR	208 218	203 537	0,33
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	238 000	EUR	234 879	231 798	0,37
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	206 000	EUR	201 062	198 419	0,32
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	223 000	EUR	211 433	211 603	0,34
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	202 000	EUR	192 846	190 694	0,31
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	220 000	EUR	217 951	214 683	0,34
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 22 - 15.05.38	165 000	EUR	139 456	140 184	0,22
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	278 000	EUR	253 435	225 822	0,36
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	66 000	EUR	63 905	64 512	0,10
Bundesrepublik Deutschland 1.70% 22 - 15.08.32	187 000	EUR	180 329	182 940	0,29
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 22 - 15.08.53	186 000	EUR	160 252	167 714	0,27
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	26 000	EUR	22 806	23 497	0,04
Bundesrepublik Deutschland 2.10% 22 - 15.11.29	178 000	EUR	175 323	179 668	0,29
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 23 - 13.04.28	201 000	EUR	199 159	202 823	0,32
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	295 000	EUR	292 566	302 260	0,48
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	50 000	EUR	49 682	51 205	0,08

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.40% 23 - 19.10.28	190 000	EUR	189 009	193 855	0,31
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 15.11.30	87 000	EUR	87 152	89 514	0,14
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 04.07.44	219 000	EUR	241 524	226 251	0,36
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	205 000	EUR	228 864	212 886	0,34
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	138 000	EUR	137 232	137 452	0,22
Bundesrepublik Deutschland 2.60% 23 - 15.08.33	172 000	EUR	173 657	180 426	0,29
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	141 000	EUR	140 739	141 255	0,23
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	81 000	EUR	81 114	81 782	0,13
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	45 000	EUR	45 229	45 585	0,07
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 04.07.42	147 000	EUR	181 638	167 879	0,27
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 04.01.37	202 000	EUR	244 549	242 889	0,39
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 04.07.39	128 000	EUR	169 394	161 046	0,26
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 04.07.28	102 000	EUR	116 304	113 842	0,18
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 04.07.34	163 000	EUR	211 695	203 739	0,33
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	151 000	EUR	206 648	201 990	0,32
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 04.01.31	136 000	EUR	172 497	167 062	0,27
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 04.01.28	119 000	EUR	137 261	135 295	0,22
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 04.01.30	94 000	EUR	120 035	116 518	0,19
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 04.07.27	71 000	EUR	83 241	81 414	0,13
			9 708 951	9 543 904	15,27
Irlande					
Ireland Zero Coupon 21 - 18.10.31	26 000	EUR	22 541	21 731	0,04
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	21 000	EUR	19 882	19 637	0,03
Ireland 0.35% 22 - 18.10.32	15 000	EUR	12 094	12 594	0,02
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	10 000	EUR	9 009	7 908	0,01
Ireland 0.55% 21 - 22.04.41	12 000	EUR	8 864	8 362	0,01
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	23 000	EUR	22 111	21 744	0,04
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	31 000	EUR	30 267	30 058	0,05
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	29 000	EUR	27 736	27 350	0,04
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	13 000	EUR	11 664	11 774	0,02
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	17 000	EUR	16 016	15 951	0,03
Ireland 1.50% 19 - 15.05.50	26 000	EUR	18 998	19 479	0,03
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	25 000	EUR	21 595	22 250	0,04
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	28 000	EUR	26 108	24 091	0,04
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	25 000	EUR	24 796	25 198	0,04
Ireland 3.00% 23 - 18.10.43	8 000	EUR	7 706	8 271	0,01
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	32 000	EUR	33 133	32 851	0,05
			312 520	309 249	0,50
Israël					
Israel 0.50% 20 - 30.04.25	80 000	ILS	19 579	19 253	0,03
Israel 0.50% 21 - 27.02.26	47 000	ILS	11 993	11 034	0,02
Israel 1.00% 19 - 31.03.30	66 000	ILS	15 322	14 056	0,02
Israel 1.30% 21 - 30.04.32	40 000	ILS	8 834	8 193	0,01
Israel 1.50% 20 - 31.05.37	60 000	ILS	12 371	10 834	0,02
Israel 1.75% 15 - 31.08.25	57 000	ILS	14 849	13 865	0,02
Israel 2.00% 16 - 31.03.27	40 000	ILS	9 896	9 555	0,02
Israel 2.25% 18 - 28.09.28	58 000	ILS	14 722	13 704	0,02
Israel 2.80% 22 - 29.11.52	20 000	ILS	4 548	3 593	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Israël (suite)					
Israel 3.75% 17 - 31.03.47	60 000	ILS	17 644	13 365	0,02
Israel 3.75% 23 - 28.02.29	10 000	ILS	2 467	2 519	0,00
Israel 5.50% 12 - 31.01.42	45 000	ILS	14 626	12 853	0,02
Israel 6.25% 06 - 30.10.26	38 000	ILS	11 252	10 194	0,02
			158 103	143 018	0,23
Japon					
Japan 0.005% 21 - 20.03.26	3 000 000	JPY	20 482	19 255	0,03
Japan 0.005% 21 - 20.06.26	1 950 000	JPY	14 096	12 513	0,02
Japan 0.005% 21 - 20.09.26	1 450 000	JPY	11 295	9 300	0,01
Japan 0.005% 22 - 20.12.26	1 700 000	JPY	12 288	10 901	0,02
Japan 0.005% 22 - 20.03.27	5 150 000	JPY	33 384	33 007	0,05
Japan 0.005% 22 - 20.06.27	2 850 000	JPY	20 032	18 248	0,03
Japan 0.005% 23 - 01.01.25	3 000 000	JPY	18 763	19 271	0,03
Japan 0.005% 23 - 01.02.25	1 850 000	JPY	12 741	11 884	0,02
Japan 0.005% 23 - 01.03.25	7 000 000	JPY	44 760	44 964	0,07
Japan 0.005% 23 - 01.05.25	5 700 000	JPY	38 148	36 605	0,06
Japan 0.005% 23 - 01.12.25	3 000 000	JPY	19 169	19 256	0,03
Japan 0.10% 16 - 20.03.26	650 000	JPY	4 502	4 181	0,01
Japan 0.10% 16 - 20.06.26	750 000	JPY	5 542	4 824	0,01
Japan 0.10% 16 - 20.09.26	1 200 000	JPY	7 958	7 717	0,01
Japan 0.10% 16 - 20.12.26	1 850 000	JPY	13 726	11 896	0,02
Japan 0.10% 17 - 20.03.27	1 100 000	JPY	7 819	7 071	0,01
Japan 0.10% 17 - 20.06.27	1 450 000	JPY	11 345	9 315	0,01
Japan 0.10% 17 - 20.09.27	2 250 000	JPY	14 966	14 442	0,02
Japan 0.10% 17 - 20.12.27	1 750 000	JPY	12 220	11 222	0,02
Japan 0.10% 18 - 20.03.28	1 450 000	JPY	10 618	9 288	0,01
Japan 0.10% 18 - 20.06.28	850 000	JPY	6 065	5 438	0,01
Japan 0.10% 18 - 20.09.28	600 000	JPY	4 437	3 832	0,01
Japan 0.10% 19 - 20.12.28	1 800 000	JPY	12 662	11 488	0,02
Japan 0.10% 19 - 20.03.29	1 050 000	JPY	7 686	6 696	0,01
Japan 0.10% 19 - 20.06.29	1 500 000	JPY	10 844	9 559	0,02
Japan 0.10% 19 - 20.09.29	750 000	JPY	5 558	4 775	0,01
Japan 0.10% 20 - 20.12.29	1 600 000	JPY	12 166	10 176	0,02
Japan 0.10% 20 - 20.03.30	2 500 000	JPY	15 559	15 878	0,03
Japan 0.10% 20 - 20.03.25	1 450 000	JPY	10 426	9 324	0,01
Japan 0.10% 20 - 20.06.30	1 050 000	JPY	7 600	6 654	0,01
Japan 0.10% 20 - 20.06.25	2 400 000	JPY	15 630	15 432	0,02
Japan 0.10% 20 - 20.09.30	1 000 000	JPY	7 888	6 325	0,01
Japan 0.10% 20 - 20.09.25	1 250 000	JPY	9 818	8 039	0,01
Japan 0.10% 21 - 20.12.30	1 200 000	JPY	8 567	7 568	0,01
Japan 0.10% 21 - 20.12.25	800 000	JPY	5 595	5 145	0,01
Japan 0.10% 21 - 20.03.31	6 450 000	JPY	39 214	40 578	0,06
Japan 0.10% 21 - 20.06.31	1 200 000	JPY	8 789	7 524	0,01
Japan 0.10% 21 - 20.09.31	1 000 000	JPY	7 786	6 253	0,01
Japan 0.10% 22 - 20.12.31	1 500 000	JPY	10 831	9 352	0,02
Japan 0.10% 22 - 20.03.27	1 550 000	JPY	11 445	9 964	0,02
Japan 0.10% 22 - 20.09.27	2 100 000	JPY	14 288	13 479	0,02
Japan 0.10% 23 - 20.03.28	3 350 000	JPY	22 403	21 457	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.10% 23 - 20.06.28	2 000 000	JPY	12 582	12 796	0,02
Japan 0.20% 16 - 20.06.36	900 000	JPY	6 956	5 323	0,01
Japan 0.20% 22 - 20.06.32	1 500 000	JPY	9 879	9 382	0,02
Japan 0.20% 23 - 20.12.27	1 800 000	JPY	12 384	11 588	0,02
Japan 0.20% 23 - 20.03.28	1 100 000	JPY	7 149	7 075	0,01
Japan 0.20% 23 - 20.06.28	2 000 000	JPY	12 632	12 852	0,02
Japan 0.30% 15 - 20.12.25	250 000	JPY	1 959	1 614	0,00
Japan 0.30% 16 - 20.06.46	1 000 000	JPY	6 357	4 970	0,01
Japan 0.30% 19 - 20.06.39	4 250 000	JPY	25 367	24 124	0,04
Japan 0.30% 19 - 20.09.39	3 100 000	JPY	22 371	17 516	0,03
Japan 0.30% 20 - 20.12.39	2 050 000	JPY	14 760	11 522	0,02
Japan 0.30% 23 - 20.12.27	2 000 000	JPY	14 268	12 926	0,02
Japan 0.30% 23 - 20.06.28	6 000 000	JPY	37 268	38 727	0,06
Japan 0.40% 15 - 20.03.25	1 500 000	JPY	9 535	9 681	0,02
Japan 0.40% 15 - 20.06.25	800 000	JPY	5 945	5 167	0,01
Japan 0.40% 15 - 20.09.25	1 700 000	JPY	11 383	10 989	0,02
Japan 0.40% 16 - 20.03.36	1 250 000	JPY	8 947	7 612	0,01
Japan 0.40% 16 - 20.03.56	3 650 000	JPY	18 105	16 038	0,03
Japan 0.40% 19 - 20.03.39	1 450 000	JPY	11 386	8 404	0,01
Japan 0.40% 19 - 20.06.49	1 500 000	JPY	7 239	7 252	0,01
Japan 0.40% 19 - 20.09.49	1 500 000	JPY	10 037	7 221	0,01
Japan 0.40% 20 - 20.12.49	1 550 000	JPY	8 733	7 437	0,01
Japan 0.40% 20 - 20.03.50	1 050 000	JPY	6 933	5 017	0,01
Japan 0.40% 20 - 20.03.40	4 900 000	JPY	31 100	27 872	0,04
Japan 0.40% 20 - 20.06.40	2 150 000	JPY	14 502	12 158	0,02
Japan 0.40% 20 - 20.09.40	5 800 000	JPY	36 038	32 647	0,05
Japan 0.40% 21 - 20.06.41	3 600 000	JPY	26 224	19 965	0,03
Japan 0.40% 23 - 20.06.33	4 850 000	JPY	30 470	30 589	0,05
Japan 0.50% 16 - 20.09.36	2 650 000	JPY	17 683	16 224	0,03
Japan 0.50% 16 - 20.09.46	1 200 000	JPY	8 441	6 232	0,01
Japan 0.50% 18 - 20.03.38	2 300 000	JPY	17 138	13 761	0,02
Japan 0.50% 18 - 20.06.38	2 500 000	JPY	18 039	14 899	0,02
Japan 0.50% 19 - 20.12.38	2 150 000	JPY	15 050	12 703	0,02
Japan 0.50% 19 - 20.03.49	1 900 000	JPY	11 673	9 477	0,02
Japan 0.50% 19 - 20.03.59	1 800 000	JPY	10 275	7 908	0,01
Japan 0.50% 20 - 20.03.60	5 150 000	JPY	26 270	22 386	0,04
Japan 0.50% 21 - 20.12.40	3 050 000	JPY	21 535	17 371	0,03
Japan 0.50% 21 - 20.03.41	5 300 000	JPY	31 646	30 051	0,05
Japan 0.50% 21 - 20.09.41	4 300 000	JPY	30 236	24 176	0,04
Japan 0.50% 22 - 20.12.41	2 900 000	JPY	18 274	16 253	0,03
Japan 0.50% 23 - 20.12.32	500 000	JPY	3 624	3 196	0,01
Japan 0.50% 23 - 20.03.33	3 350 000	JPY	21 818	21 369	0,03
Japan 0.60% 16 - 20.12.36	2 200 000	JPY	17 214	13 602	0,02
Japan 0.60% 16 - 20.12.46	1 000 000	JPY	6 562	5 298	0,01
Japan 0.60% 17 - 20.06.37	1 100 000	JPY	7 815	6 748	0,01
Japan 0.60% 17 - 20.09.37	5 300 000	JPY	33 290	32 398	0,05
Japan 0.60% 17 - 20.12.37	1 100 000	JPY	7 765	6 701	0,01
Japan 0.60% 20 - 20.06.50	3 150 000	JPY	21 626	15 859	0,03

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.60% 20 - 20.09.50	2 850 000	JPY	17 800	14 294	0,02
Japan 0.70% 17 - 20.03.37	1 700 000	JPY	12 635	10 604	0,02
Japan 0.70% 18 - 20.06.48	5 550 000	JPY	31 018	29 508	0,05
Japan 0.70% 18 - 20.09.38	4 000 000	JPY	26 392	24 441	0,04
Japan 0.70% 19 - 20.12.48	3 800 000	JPY	25 559	20 045	0,03
Japan 0.70% 21 - 20.12.50	1 450 000	JPY	8 911	7 460	0,01
Japan 0.70% 21 - 20.03.51	2 150 000	JPY	15 260	11 022	0,02
Japan 0.70% 21 - 20.03.61	4 350 000	JPY	23 926	20 158	0,03
Japan 0.70% 21 - 20.06.51	1 850 000	JPY	12 597	9 449	0,02
Japan 0.70% 21 - 20.09.51	1 800 000	JPY	11 174	9 168	0,01
Japan 0.70% 22 - 20.12.51	2 750 000	JPY	18 483	13 982	0,02
Japan 0.80% 16 - 20.03.46	1 100 000	JPY	7 136	6 156	0,01
Japan 0.80% 17 - 20.03.47	1 400 000	JPY	10 136	7 737	0,01
Japan 0.80% 17 - 20.06.47	1 750 000	JPY	10 800	9 648	0,02
Japan 0.80% 17 - 20.09.47	1 050 000	JPY	7 026	5 770	0,01
Japan 0.80% 17 - 20.12.47	1 750 000	JPY	12 625	9 586	0,02
Japan 0.80% 18 - 20.03.48	1 450 000	JPY	8 640	7 923	0,01
Japan 0.80% 18 - 20.03.58	1 550 000	JPY	10 888	7 664	0,01
Japan 0.80% 22 - 20.03.42	4 800 000	JPY	27 852	28 280	0,05
Japan 0.80% 23 - 20.09.33	2 000 000	JPY	13 034	13 058	0,02
Japan 0.90% 17 - 20.03.57	3 050 000	JPY	20 641	15 703	0,03
Japan 0.90% 18 - 20.09.48	2 550 000	JPY	16 120	14 166	0,02
Japan 0.90% 22 - 20.06.42	4 550 000	JPY	29 084	27 187	0,04
Japan 1.00% 15 - 20.12.35	2 500 000	JPY	16 074	16 375	0,03
Japan 1.00% 22 - 20.03.52	2 400 000	JPY	17 058	13 201	0,02
Japan 1.00% 22 - 20.03.62	4 200 000	JPY	23 623	21 376	0,03
Japan 1.10% 22 - 20.09.42	3 500 000	JPY	24 675	21 593	0,03
Japan 1.10% 23 - 20.03.43	3 200 000	JPY	21 612	19 645	0,03
Japan 1.10% 23 - 20.06.43	2 500 000	JPY	15 143	15 302	0,02
Japan 1.20% 14 - 20.12.34	4 000 000	JPY	27 743	26 946	0,04
Japan 1.20% 15 - 20.03.35	3 100 000	JPY	21 030	20 855	0,03
Japan 1.20% 15 - 20.09.35	1 400 000	JPY	12 214	9 386	0,02
Japan 1.20% 23 - 20.06.53	2 000 000	JPY	11 513	11 496	0,02
Japan 1.30% 15 - 20.06.35	1 300 000	JPY	11 446	8 826	0,01
Japan 1.30% 22 - 20.06.52	4 850 000	JPY	30 760	28 713	0,05
Japan 1.30% 23 - 20.03.63	1 100 000	JPY	6 431	6 116	0,01
Japan 1.40% 14 - 20.09.34	2 500 000	JPY	21 995	17 182	0,03
Japan 1.40% 15 - 20.03.55	1 150 000	JPY	7 958	6 908	0,01
Japan 1.40% 15 - 20.09.45	450 000	JPY	4 145	2 852	0,00
Japan 1.40% 15 - 20.12.45	500 000	JPY	4 589	3 163	0,01
Japan 1.40% 22 - 20.09.52	3 050 000	JPY	21 908	18 491	0,03
Japan 1.40% 23 - 20.12.42	3 250 000	JPY	21 706	21 029	0,03
Japan 1.40% 23 - 20.03.53	2 850 000	JPY	17 753	17 240	0,03
Japan 1.50% 12 - 20.06.32	600 000	JPY	5 232	4 166	0,01
Japan 1.50% 13 - 20.03.33	1 150 000	JPY	9 422	7 995	0,01
Japan 1.50% 14 - 20.03.34	1 000 000	JPY	8 849	6 950	0,01
Japan 1.50% 14 - 20.06.34	1 600 000	JPY	13 142	11 110	0,02
Japan 1.50% 14 - 20.12.44	700 000	JPY	5 683	4 542	0,01

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.50% 15 - 20.03.45	3 250 000	JPY	21 863	21 051	0,03
Japan 1.60% 10 - 20.06.30	750 000	JPY	5 805	5 217	0,01
Japan 1.60% 12 - 20.03.32	500 000	JPY	4 412	3 496	0,01
Japan 1.60% 12 - 20.06.32	450 000	JPY	3 713	3 148	0,01
Japan 1.60% 13 - 20.03.33	550 000	JPY	4 224	3 855	0,01
Japan 1.60% 13 - 20.12.33	2 200 000	JPY	17 841	15 431	0,02
Japan 1.60% 15 - 20.06.45	600 000	JPY	4 747	3 952	0,01
Japan 1.60% 23 - 20.12.52	3 150 000	JPY	22 604	19 988	0,03
Japan 1.70% 03 - 20.06.33	450 000	JPY	3 725	3 183	0,01
Japan 1.70% 11 - 20.09.31	550 000	JPY	4 834	3 867	0,01
Japan 1.70% 11 - 20.12.31	1 650 000	JPY	12 761	11 609	0,02
Japan 1.70% 12 - 20.03.32	350 000	JPY	2 894	2 465	0,00
Japan 1.70% 12 - 20.06.32	400 000	JPY	3 486	2 819	0,00
Japan 1.70% 12 - 20.09.32	1 800 000	JPY	15 317	12 705	0,02
Japan 1.70% 12 - 20.12.32	1 300 000	JPY	10 575	9 183	0,01
Japan 1.70% 13 - 20.06.33	2 350 000	JPY	19 422	16 622	0,03
Japan 1.70% 13 - 20.09.33	1 450 000	JPY	11 538	10 253	0,02
Japan 1.70% 13 - 20.12.43	1 050 000	JPY	7 996	7 093	0,01
Japan 1.70% 14 - 20.03.44	1 350 000	JPY	12 191	9 106	0,01
Japan 1.70% 14 - 20.03.54	1 050 000	JPY	6 802	6 807	0,01
Japan 1.70% 14 - 20.06.44	800 000	JPY	6 720	5 393	0,01
Japan 1.70% 14 - 20.09.44	1 350 000	JPY	11 830	9 089	0,01
Japan 1.80% 02 - 22.11.32	500 000	JPY	4 182	3 558	0,01
Japan 1.80% 10 - 20.06.30	150 000	JPY	1 229	1 056	0,00
Japan 1.80% 10 - 20.09.30	600 000	JPY	4 944	4 229	0,01
Japan 1.80% 11 - 20.06.31	600 000	JPY	4 757	4 242	0,01
Japan 1.80% 11 - 20.09.31	800 000	JPY	7 080	5 663	0,01
Japan 1.80% 12 - 20.12.31	1 500 000	JPY	12 124	10 628	0,02
Japan 1.80% 12 - 20.03.32	3 950 000	JPY	29 379	28 019	0,04
Japan 1.80% 13 - 20.12.32	300 000	JPY	2 343	2 136	0,00
Japan 1.80% 13 - 20.03.43	1 750 000	JPY	15 748	12 064	0,02
Japan 1.80% 13 - 20.09.43	2 300 000	JPY	16 530	15 810	0,03
Japan 1.80% 23 - 20.09.53	1 000 000	JPY	6 655	6 640	0,01
Japan 1.90% 05 - 20.06.25	1 300 000	JPY	9 384	8 578	0,01
Japan 1.90% 09 - 20.12.28	800 000	JPY	6 303	5 562	0,01
Japan 1.90% 09 - 20.03.29	400 000	JPY	3 446	2 790	0,00
Japan 1.90% 10 - 20.09.30	2 000 000	JPY	14 509	14 180	0,02
Japan 1.90% 11 - 20.03.31	600 000	JPY	4 616	4 267	0,01
Japan 1.90% 11 - 20.06.31	1 950 000	JPY	15 240	13 876	0,02
Japan 1.90% 12 - 20.09.42	5 800 000	JPY	45 986	40 680	0,07
Japan 1.90% 13 - 20.03.53	2 750 000	JPY	19 577	18 669	0,03
Japan 1.90% 13 - 20.06.43	1 750 000	JPY	14 087	12 234	0,02
Japan 2.00% 04 - 20.12.33	100 000	JPY	860	726	0,00
Japan 2.00% 05 - 20.09.25	650 000	JPY	4 781	4 316	0,01
Japan 2.00% 06 - 20.12.25	850 000	JPY	6 527	5 670	0,01
Japan 2.00% 07 - 20.03.27	1 250 000	JPY	9 824	8 524	0,01
Japan 2.00% 10 - 20.06.30	400 000	JPY	3 558	2 848	0,00
Japan 2.00% 10 - 20.09.40	5 300 000	JPY	40 002	38 013	0,06

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.00% 11 - 20.12.30	300 000	JPY	2 493	2 143	0,00
Japan 2.00% 11 - 20.03.31	1 650 000	JPY	13 793	11 808	0,02
Japan 2.00% 11 - 20.09.41	4 250 000	JPY	34 801	30 331	0,05
Japan 2.00% 12 - 20.03.42	2 000 000	JPY	18 371	14 270	0,02
Japan 2.00% 12 - 20.03.52	1 500 000	JPY	11 762	10 409	0,02
Japan 2.10% 03 - 20.09.33	450 000	JPY	3 893	3 291	0,01
Japan 2.10% 05 - 20.03.25	2 450 000	JPY	17 124	16 134	0,03
Japan 2.10% 05 - 20.09.25	900 000	JPY	6 817	5 985	0,01
Japan 2.10% 05 - 20.12.25	600 000	JPY	4 612	4 010	0,01
Japan 2.10% 06 - 20.03.26	600 000	JPY	4 512	4 029	0,01
Japan 2.10% 06 - 20.12.26	1 000 000	JPY	7 831	6 810	0,01
Japan 2.10% 07 - 20.03.27	500 000	JPY	4 142	3 420	0,01
Japan 2.10% 07 - 20.06.27	450 000	JPY	3 441	3 090	0,00
Japan 2.10% 07 - 20.09.27	100 000	JPY	845	689	0,00
Japan 2.10% 07 - 20.12.27	750 000	JPY	6 411	5 189	0,01
Japan 2.10% 08 - 20.06.28	3 200 000	JPY	22 451	22 300	0,04
Japan 2.10% 08 - 20.09.28	1 500 000	JPY	10 315	10 483	0,02
Japan 2.10% 08 - 20.12.28	600 000	JPY	5 201	4 209	0,01
Japan 2.10% 09 - 20.03.29	1 350 000	JPY	11 830	9 506	0,02
Japan 2.10% 09 - 20.06.29	1 700 000	JPY	12 165	12 016	0,02
Japan 2.10% 09 - 20.09.29	1 000 000	JPY	7 159	7 093	0,01
Japan 2.10% 09 - 20.12.29	1 050 000	JPY	8 289	7 471	0,01
Japan 2.10% 10 - 20.03.30	3 250 000	JPY	25 538	23 202	0,04
Japan 2.10% 10 - 20.12.30	3 250 000	JPY	26 381	23 362	0,04
Japan 2.20% 06 - 20.03.26	1 100 000	JPY	8 143	7 402	0,01
Japan 2.20% 06 - 20.06.26	300 000	JPY	2 313	2 029	0,00
Japan 2.20% 06 - 20.09.26	550 000	JPY	4 143	3 737	0,01
Japan 2.20% 07 - 20.09.27	300 000	JPY	2 388	2 075	0,00
Japan 2.20% 08 - 20.03.28	1 150 000	JPY	9 846	8 014	0,01
Japan 2.20% 08 - 20.09.28	400 000	JPY	3 466	2 807	0,00
Japan 2.20% 09 - 20.03.49	750 000	JPY	7 997	5 429	0,01
Japan 2.20% 09 - 20.06.29	1 200 000	JPY	9 905	8 524	0,01
Japan 2.20% 09 - 20.09.39	1 800 000	JPY	14 536	13 316	0,02
Japan 2.20% 10 - 20.12.29	700 000	JPY	5 822	5 007	0,01
Japan 2.20% 10 - 20.03.30	1 250 000	JPY	10 016	8 973	0,01
Japan 2.20% 10 - 20.03.50	5 200 000	JPY	36 143	37 612	0,06
Japan 2.20% 11 - 20.03.31	200 000	JPY	1 693	1 449	0,00
Japan 2.20% 11 - 20.03.41	2 450 000	JPY	20 294	18 011	0,03
Japan 2.20% 11 - 20.03.51	650 000	JPY	6 322	4 697	0,01
Japan 2.30% 02 - 20.05.32	550 000	JPY	5 119	4 048	0,01
Japan 2.30% 05 - 20.03.35	500 000	JPY	4 807	3 745	0,01
Japan 2.30% 06 - 20.12.35	450 000	JPY	4 393	3 373	0,01
Japan 2.30% 06 - 20.03.26	350 000	JPY	2 878	2 360	0,00
Japan 2.30% 06 - 20.06.26	1 800 000	JPY	13 526	12 202	0,02
Japan 2.30% 07 - 20.12.36	3 300 000	JPY	24 831	24 789	0,04
Japan 2.30% 07 - 20.06.27	700 000	JPY	5 525	4 838	0,01
Japan 2.30% 08 - 20.06.28	1 100 000	JPY	8 606	7 728	0,01
Japan 2.30% 09 - 20.03.39	2 000 000	JPY	16 291	14 991	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.30% 10 - 20.03.40	1 950 000	JPY	18 344	14 574	0,02
Japan 2.40% 04 - 20.03.34	1 350 000	JPY	11 100	10 150	0,02
Japan 2.40% 05 - 20.12.34	1 200 000	JPY	10 748	9 055	0,01
Japan 2.40% 07 - 20.03.37	1 700 000	JPY	15 745	12 905	0,02
Japan 2.40% 07 - 20.03.48	1 150 000	JPY	10 365	8 652	0,01
Japan 2.40% 08 - 20.03.28	50 000	JPY	406	351	0,00
Japan 2.40% 08 - 20.06.28	300 000	JPY	2 604	2 116	0,00
Japan 2.40% 08 - 20.09.38	1 800 000	JPY	14 911	13 666	0,02
Japan 2.50% 04 - 20.06.34	600 000	JPY	5 404	4 554	0,01
Japan 2.50% 04 - 20.09.34	50 000	JPY	452	380	0,00
Japan 2.50% 05 - 20.09.35	1 150 000	JPY	10 050	8 782	0,01
Japan 2.50% 06 - 20.03.36	2 750 000	JPY	22 580	21 035	0,03
Japan 2.50% 06 - 20.06.36	1 200 000	JPY	10 549	9 184	0,01
Japan 2.50% 06 - 20.09.36	350 000	JPY	3 495	2 681	0,00
Japan 2.50% 07 - 20.09.37	1 100 000	JPY	10 318	8 439	0,01
Japan 2.50% 08 - 20.03.38	2 200 000	JPY	18 564	16 884	0,03
			3 298 821	2 942 763	4,71
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.07.30	115 000	EUR	100 548	99 786	0,16
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.27	120 000	EUR	112 009	112 212	0,18
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.52	140 613	EUR	77 206	72 106	0,11
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.07.31	115 000	EUR	98 414	97 405	0,16
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.38	79 000	EUR	57 357	55 719	0,09
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.29	102 000	EUR	90 446	91 545	0,15
Netherlands 144A Zero Coupon 22 - 15.01.26	128 000	EUR	121 900	121 676	0,19
Netherlands 144A 0.25% 15 - 15.07.25	146 000	EUR	142 318	140 919	0,23
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	96 000	EUR	90 096	86 515	0,14
Netherlands 144A 0.50% 16 - 15.07.26	146 000	EUR	141 351	139 605	0,22
Netherlands 144A 0.50% 19 - 15.01.40	128 000	EUR	98 758	94 579	0,15
Netherlands 144A 0.50% 22 - 15.07.32	100 000	EUR	86 483	85 970	0,14
Netherlands 144A 0.75% 17 - 15.07.27	154 000	EUR	147 049	146 546	0,23
Netherlands 144A 0.75% 18 - 15.07.28	147 000	EUR	141 201	138 077	0,22
Netherlands 144A 2.00% 22 - 15.01.54	68 000	EUR	59 192	61 214	0,10
Netherlands 144A 2.50% 12 - 15.01.33	119 000	EUR	124 719	120 607	0,19
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.07.33	99 000	EUR	94 951	100 109	0,16
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.01.30	63 000	EUR	62 386	64 077	0,10
Netherlands 144A 2.75% 14 - 15.01.47	153 000	EUR	171 218	159 977	0,26
Netherlands 144A 3.25% 23 - 15.01.44	50 000	EUR	49 288	55 533	0,09
Netherlands 144A 3.75% 10 - 15.01.42	149 000	EUR	181 967	175 313	0,28
Netherlands 144A 4.00% 05 - 15.01.37	150 000	EUR	183 392	174 705	0,28
Netherlands 144A 5.50% 98 - 15.01.28	101 000	EUR	114 635	113 595	0,18
			2 546 884	2 507 790	4,01
Nouvelle-Zélande					
New Zealand 0.25% 20 - 15.05.28	36 000	NZD	17 594	17 420	0,03
New Zealand 0.50% 21 - 15.05.26	29 000	NZD	14 991	15 177	0,02
New Zealand 1.50% 19 - 15.05.31	24 000	NZD	11 747	11 362	0,02
New Zealand 1.75% 20 - 15.05.41	21 000	NZD	7 809	7 913	0,01
New Zealand 2.00% 21 - 15.05.32	29 000	NZD	13 986	13 954	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
New Zealand 2.75% 16 - 15.04.25	54 000	NZD	30 260	30 090	0,05
New Zealand 2.75% 16 - 15.04.37	20 000	NZD	9 743	9 418	0,01
New Zealand 2.75% 21 - 15.05.51	28 000	NZD	11 571	11 443	0,02
New Zealand 3.00% 18 - 20.04.29	18 000	NZD	9 811	9 754	0,02
New Zealand 3.50% 15 - 14.04.33	50 000	NZD	26 299	26 845	0,04
New Zealand 4.25% 22 - 15.05.34	20 000	NZD	11 405	11 333	0,02
New Zealand 4.50% 14 - 15.04.27	38 000	NZD	22 006	21 920	0,04
New Zealand 4.50% 23 - 15.05.30	32 000	NZD	17 510	18 624	0,03
			204 732	205 253	0,33
Norvège					
Norway 144A 1.25% 21 - 17.09.31	562 000	NOK	44 837	43 228	0,07
Norway 144A 1.375% 20 - 19.08.30	628 000	NOK	55 437	49 557	0,08
Norway 144A 1.50% 16 - 19.02.26	552 000	NOK	48 239	47 093	0,07
Norway 144A 1.75% 15 - 13.03.25	660 000	NOK	61 345	57 384	0,09
Norway 144A 1.75% 17 - 17.02.27	519 000	NOK	48 168	44 065	0,07
Norway 144A 1.75% 19 - 06.09.29	438 000	NOK	37 385	35 935	0,06
Norway 144A 2.00% 18 - 26.04.28	437 000	NOK	39 305	36 975	0,06
Norway 144A 2.125% 22 - 18.05.32	535 000	NOK	47 331	43 590	0,07
Norway 144A 3.00% 23 - 15.08.33	483 000	NOK	39 794	41 993	0,07
Norway 144A 3.50% 22 - 06.10.42	240 000	NOK	19 716	22 433	0,04
			441 557	422 253	0,68
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	10 000	EUR	9 736	9 671	0,02
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	9 000	EUR	8 755	8 514	0,01
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	16 000	EUR	14 215	14 443	0,02
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.27	20 000	EUR	18 694	18 497	0,03
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	10 000	EUR	9 638	9 596	0,02
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	22 000	EUR	19 598	19 936	0,03
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	32 000	EUR	31 634	32 119	0,05
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	12 000	EUR	16 890	14 617	0,02
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	14 000	EUR	16 439	16 251	0,03
Spain 144A 0.10% 21 - 30.04.31	14 000	EUR	11 539	11 562	0,02
Spain 144A 0.50% 20 - 30.04.30	15 000	EUR	13 034	13 125	0,02
Spain 144A 0.50% 21 - 31.10.31	26 000	EUR	21 597	21 849	0,04
Spain 144A 0.60% 19 - 31.10.29	10 000	EUR	10 302	8 914	0,01
Spain 144A 0.70% 22 - 30.04.32	9 000	EUR	8 466	7 588	0,01
Spain 144A 0.80% 20 - 30.07.27	16 000	EUR	15 928	15 052	0,02
Spain 144A 0.85% 21 - 30.07.37	17 000	EUR	12 061	12 487	0,02
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	16 000	EUR	10 432	8 966	0,01
Spain 144A 1.00% 21 - 30.07.42	7 000	EUR	5 565	4 669	0,01
Spain 144A 1.20% 20 - 31.10.40	11 000	EUR	11 069	7 840	0,01
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	22 000	EUR	19 949	20 003	0,03
Spain 144A 1.30% 16 - 31.10.26	13 000	EUR	12 871	12 554	0,02
Spain 144A 1.40% 18 - 30.04.28	13 000	EUR	12 881	12 396	0,02
Spain 144A 1.40% 18 - 30.07.28	10 000	EUR	10 057	9 505	0,02
Spain 144A 1.45% 17 - 31.10.27	15 000	EUR	14 601	14 411	0,02
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	11 000	EUR	10 771	10 383	0,02
Spain 144A 1.45% 21 - 31.10.71	1 000	EUR	521	489	0,00

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.50% 17 - 30.04.27	14 000	EUR	13 435	13 534	0,02
Spain 144A 1.60% 15 - 30.04.25	22 000	EUR	21 592	21 598	0,04
Spain 144A 1.85% 19 - 30.07.35	15 000	EUR	12 943	13 126	0,02
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	4 000	EUR	3 406	2 763	0,00
Spain 144A 1.95% 15 - 30.07.30	10 000	EUR	10 246	9 557	0,02
Spain 144A 1.95% 16 - 30.04.26	13 000	EUR	12 735	12 795	0,02
Spain 144A 2.15% 15 - 31.10.25	10 000	EUR	10 249	9 895	0,02
Spain 144A 2.35% 17 - 30.07.33	18 000	EUR	17 782	17 099	0,03
Spain 144A 2.55% 22 - 31.10.32	14 000	EUR	13 112	13 639	0,02
Spain 144A 2.70% 18 - 31.10.48	9 000	EUR	7 491	7 719	0,01
Spain 144A 2.90% 16 - 31.10.46	9 000	EUR	11 129	8 110	0,01
Spain 144A 3.15% 23 - 30.04.33	11 000	EUR	10 668	11 174	0,02
Spain 144A 3.45% 16 - 30.07.66	14 000	EUR	13 768	12 921	0,02
Spain 144A 3.45% 22 - 30.07.43	4 000	EUR	3 785	3 960	0,01
Spain 144A 3.55% 23 - 31.10.33	20 000	EUR	19 842	20 929	0,03
Spain 144A 3.90% 23 - 30.07.39	12 000	EUR	11 986	12 706	0,02
Spain 144A 4.20% 05 - 31.01.37	14 000	EUR	15 723	15 445	0,03
Spain 144A 4.65% 10 - 30.07.25	19 000	EUR	20 464	19 502	0,03
Spain 144A 4.70% 09 - 30.07.41	12 000	EUR	14 155	13 989	0,02
Spain 144A 4.90% 07 - 30.07.40	12 000	EUR	14 268	14 167	0,02
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.28	20 000	EUR	21 977	22 324	0,04
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.44	16 000	EUR	19 680	19 841	0,03
Spain 144A 5.90% 11 - 30.07.26	12 000	EUR	13 633	12 958	0,02
			661 312	645 188	1,03
Suède					
Sweden 0.125% 20 - 12.05.31	330 000	SEK	26 129	25 860	0,04
Sweden 0.75% 17 - 12.05.28	445 000	SEK	38 552	37 814	0,06
Sweden 0.75% 18 - 12.11.29	425 000	SEK	36 839	35 556	0,06
Sweden 1.00% 15 - 12.11.26	485 000	SEK	43 074	42 034	0,07
Sweden 1.75% 22 - 11.11.33	205 000	SEK	17 058	17 985	0,03
Sweden 2.25% 12 - 01.06.32	315 000	SEK	31 041	28 764	0,05
Sweden 2.50% 14 - 12.05.25	450 000	SEK	40 696	40 199	0,06
Sweden 3.50% 09 - 30.03.39	300 000	SEK	31 882	31 328	0,05
			265 271	259 540	0,42
Royaume-Uni					
United Kingdom 0.125% 20 - 30.01.26	120 000	GBP	130 868	128 790	0,21
United Kingdom 0.125% 20 - 31.01.28	111 000	GBP	116 602	112 406	0,18
United Kingdom 0.25% 20 - 31.07.31	201 015	GBP	191 326	183 355	0,29
United Kingdom 0.25% 21 - 31.01.25	227 000	GBP	252 337	250 648	0,40
United Kingdom 0.375% 20 - 22.10.30	131 000	GBP	126 693	123 860	0,20
United Kingdom 0.375% 21 - 22.10.26	188 000	GBP	203 347	198 864	0,32
United Kingdom 0.50% 20 - 22.10.61	134 625	GBP	71 691	52 683	0,08
United Kingdom 0.50% 21 - 31.01.29	208 000	GBP	205 311	208 377	0,33
United Kingdom 0.625% 19 - 07.06.25	120 000	GBP	132 679	131 906	0,21
United Kingdom 0.625% 20 - 22.10.50	126 000	GBP	72 778	64 270	0,10
United Kingdom 0.625% 20 - 31.07.35	164 000	GBP	140 946	134 640	0,22
United Kingdom 0.875% 19 - 22.10.29	128 000	GBP	132 507	128 971	0,21
United Kingdom 0.875% 21 - 31.01.46	133 000	GBP	88 633	82 130	0,13

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.875% 21 - 31.07.33	207 000	GBP	189 438	187 142	0,30
United Kingdom 1.00% 21 - 31.01.32	273 000	GBP	259 312	261 145	0,42
United Kingdom 1.125% 21 - 31.01.39	169 000	GBP	137 418	132 699	0,21
United Kingdom 1.125% 22 - 22.10.73	91 000	GBP	49 734	43 918	0,07
United Kingdom 1.25% 17 - 22.07.27	108 000	GBP	119 584	115 699	0,19
United Kingdom 1.25% 20 - 22.10.41	179 000	GBP	149 586	134 230	0,21
United Kingdom 1.25% 21 - 31.07.51	208 000	GBP	137 747	127 989	0,20
United Kingdom 1.50% 16 - 22.07.26	118 000	GBP	130 900	129 485	0,21
United Kingdom 1.50% 16 - 22.07.47	138 000	GBP	115 265	96 748	0,16
United Kingdom 1.50% 21 - 31.07.53	118 000	GBP	82 145	75 918	0,12
United Kingdom 1.625% 18 - 22.10.28	102 000	GBP	112 708	109 001	0,17
United Kingdom 1.625% 18 - 22.10.71	104 661	GBP	79 680	62 589	0,10
United Kingdom 1.625% 19 - 22.10.54	98 000	GBP	80 347	64 724	0,10
United Kingdom 1.75% 16 - 07.09.37	151 000	GBP	140 919	135 207	0,22
United Kingdom 1.75% 17 - 22.07.57	144 000	GBP	126 843	96 850	0,16
United Kingdom 1.75% 18 - 22.01.49	117 000	GBP	94 469	85 482	0,14
United Kingdom 2.00% 15 - 07.09.25	127 000	GBP	145 662	142 121	0,23
United Kingdom 2.50% 15 - 22.07.65	131 000	GBP	128 293	105 826	0,17
United Kingdom 3.25% 12 - 22.01.44	156 000	GBP	174 358	158 767	0,25
United Kingdom 3.25% 23 - 31.01.33	240 000	GBP	258 239	271 040	0,43
United Kingdom 3.50% 13 - 22.07.68	106 000	GBP	136 681	110 033	0,18
United Kingdom 3.50% 14 - 22.01.45	147 000	GBP	168 419	154 680	0,25
United Kingdom 3.50% 23 - 22.10.25	232 000	GBP	262 527	265 566	0,43
United Kingdom 3.75% 11 - 22.07.52	100 000	GBP	121 839	108 433	0,17
United Kingdom 3.75% 22 - 29.01.38	128 000	GBP	141 124	144 968	0,23
United Kingdom 3.75% 23 - 22.10.53	185 000	GBP	194 205	199 426	0,32
United Kingdom 4.00% 09 - 22.01.60	91 000	GBP	122 357	103 967	0,17
United Kingdom 4.00% 23 - 22.10.63	82 000	GBP	85 295	93 703	0,15
United Kingdom 4.125% 22 - 29.01.27	252 000	GBP	289 752	295 265	0,47
United Kingdom 4.25% 00 - 07.06.32	154 000	GBP	192 492	188 206	0,30
United Kingdom 4.25% 03 - 07.03.36	125 000	GBP	159 629	151 394	0,24
United Kingdom 4.25% 05 - 07.12.55	143 000	GBP	188 818	169 268	0,27
United Kingdom 4.25% 06 - 07.12.46	132 000	GBP	168 060	154 952	0,25
United Kingdom 4.25% 06 - 07.12.27	115 000	GBP	137 899	136 828	0,22
United Kingdom 4.25% 08 - 07.12.49	90 000	GBP	120 307	105 680	0,17
United Kingdom 4.25% 09 - 07.09.39	96 000	GBP	119 421	114 299	0,18
United Kingdom 4.25% 10 - 07.12.40	107 000	GBP	145 609	126 914	0,20
United Kingdom 4.50% 07 - 07.12.42	127 000	GBP	168 669	154 638	0,25
United Kingdom 4.50% 09 - 07.09.34	99 000	GBP	128 256	122 852	0,20
United Kingdom 4.50% 23 - 07.06.28	141 000	GBP	164 184	169 666	0,27
United Kingdom 4.625% 23 - 31.01.34	90 000	GBP	105 314	112 753	0,18
United Kingdom 4.75% 04 - 07.12.38	112 000	GBP	149 667	140 936	0,23
United Kingdom 4.75% 07 - 07.12.30	140 000	GBP	177 954	174 974	0,28
United Kingdom 4.75% 23 - 22.10.43	80 000	GBP	95 346	100 225	0,16
United Kingdom 5.00% 01 - 07.03.25	125 000	GBP	149 288	145 451	0,23
United Kingdom 6.00% 98 - 07.12.28	98 000	GBP	128 106	126 554	0,20
			8 599 583	8 209 111	13,14

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
United States Zero Coupon 20 - 15.05.40	70 000	USD	46 906	40 932	0,07
United States Zero Coupon 20 - 30.06.27	97 000	USD	81 030	78 001	0,13
United States Zero Coupon 20 - 31.10.25	115 000	USD	102 221	96 704	0,15
United States Zero Coupon 20 - 31.10.27	87 000	USD	74 153	69 258	0,11
United States Zero Coupon 21 - 31.01.26	143 000	USD	122 626	119 582	0,19
United States Zero Coupon 21 - 31.03.26	100 000	USD	88 091	84 020	0,13
United States Zero Coupon 21 - 30.04.26	120 000	USD	103 233	100 501	0,16
United States Zero Coupon 21 - 30.04.28	124 000	USD	105 698	100 536	0,16
United States Zero Coupon 21 - 31.05.28	105 000	USD	92 290	84 968	0,14
United States Zero Coupon 21 - 15.05.41	133 000	USD	101 307	92 012	0,15
United States Zero Coupon 21 - 30.06.26	76 000	USD	70 033	63 629	0,10
United States Zero Coupon 21 - 31.07.26	119 000	USD	103 527	98 671	0,16
United States Zero Coupon 21 - 31.07.28	100 000	USD	89 104	79 649	0,13
United States Zero Coupon 21 - 31.08.28	121 000	USD	102 342	96 752	0,16
United States Zero Coupon 21 - 15.08.41	140 000	USD	92 270	88 399	0,14
United States Zero Coupon 21 - 30.09.26	100 000	USD	85 383	83 171	0,13
United States Zero Coupon 21 - 30.09.28	105 000	USD	93 024	84 270	0,14
United States Zero Coupon 21 - 30.11.26	126 000	USD	112 191	105 473	0,17
United States Zero Coupon 21 - 31.12.26	104 000	USD	93 650	86 925	0,14
United States Zero Coupon 21 - 31.12.28	93 000	USD	82 852	74 731	0,12
United States Zero Coupon 22 - 31.01.29	115 000	USD	98 030	93 988	0,15
United States Zero Coupon 22 - 28.02.27	93 000	USD	84 262	78 954	0,13
United States Zero Coupon 22 - 28.02.29	116 000	USD	100 503	95 264	0,15
United States Zero Coupon 22 - 15.02.42	79 000	USD	63 957	55 067	0,09
United States Zero Coupon 22 - 31.03.27	94 000	USD	86 033	81 345	0,13
United States Zero Coupon 22 - 31.03.29	71 000	USD	64 097	59 714	0,10
United States Zero Coupon 22 - 30.04.27	100 000	USD	88 256	87 103	0,14
United States Zero Coupon 22 - 30.04.29	60 000	USD	55 418	51 710	0,08
United States Zero Coupon 22 - 15.05.42	94 000	USD	79 827	74 897	0,12
United States Zero Coupon 22 - 31.07.27	81 000	USD	75 870	70 405	0,11
United States Zero Coupon 22 - 30.11.29	60 000	USD	58 767	54 265	0,09
United States Zero Coupon 23 - 31.12.24	93 000	USD	84 998	83 755	0,13
United States Zero Coupon 23 - 29.02.28	61 000	USD	57 020	55 428	0,09
United States Zero Coupon 23 - 15.02.43	58 000	USD	53 469	50 241	0,08
United States Zero Coupon 23 - 31.03.25	93 000	USD	84 207	83 453	0,13
United States Zero Coupon 23 - 30.04.28	59 000	USD	54 714	52 593	0,08
United States Zero Coupon 23 - 30.06.25	93 000	USD	84 777	84 400	0,14
United States Zero Coupon 23 - 30.06.30	75 000	USD	66 707	67 354	0,11
United States Zero Coupon 23 - 30.09.25	100 000	USD	94 442	91 460	0,15
United States Zero Coupon 23 - 30.09.28	90 000	USD	84 375	84 147	0,13
United States 0.25% 20 - 31.05.25	93 000	USD	83 334	79 283	0,13
United States 0.25% 20 - 30.06.25	116 000	USD	104 481	98 612	0,16
United States 0.25% 20 - 31.07.25	76 000	USD	69 942	64 425	0,10
United States 0.25% 20 - 31.08.25	74 000	USD	67 108	62 551	0,10
United States 0.25% 20 - 30.09.25	133 000	USD	116 904	112 123	0,18
United States 0.375% 20 - 30.04.25	94 000	USD	83 091	80 534	0,13
United States 0.375% 20 - 31.07.27	100 000	USD	84 949	79 861	0,13
United States 0.375% 20 - 30.09.27	116 000	USD	98 026	92 114	0,15

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.375% 20 - 30.11.25	111 000	USD	97 489	93 309	0,15
United States 0.375% 20 - 31.12.25	126 000	USD	112 049	105 722	0,17
United States 0.50% 20 - 31.03.25	68 000	USD	63 096	58 519	0,09
United States 0.50% 20 - 30.04.27	87 000	USD	71 858	70 328	0,11
United States 0.50% 20 - 31.05.27	49 000	USD	43 648	39 506	0,06
United States 0.50% 20 - 31.08.27	66 000	USD	55 964	52 802	0,08
United States 0.50% 21 - 28.02.26	127 000	USD	111 303	106 238	0,17
United States 0.625% 20 - 31.03.27	42 000	USD	35 166	34 183	0,05
United States 0.625% 20 - 15.05.30	143 000	USD	109 313	105 868	0,17
United States 0.625% 20 - 15.08.30	184 000	USD	147 458	135 233	0,22
United States 0.625% 20 - 30.11.27	88 000	USD	74 645	70 241	0,11
United States 0.625% 20 - 31.12.27	113 000	USD	90 871	89 956	0,14
United States 0.75% 21 - 31.01.28	111 000	USD	92 859	88 615	0,14
United States 0.75% 21 - 31.05.26	110 000	USD	95 543	91 924	0,15
United States 0.75% 21 - 31.08.26	106 000	USD	94 103	87 996	0,14
United States 0.875% 20 - 15.11.30	186 000	USD	150 162	138 492	0,22
United States 1.125% 20 - 28.02.25	49 000	USD	44 916	42 597	0,07
United States 1.125% 20 - 28.02.27	17 000	USD	14 868	14 101	0,02
United States 1.125% 20 - 15.08.40	121 000	USD	76 414	70 069	0,11
United States 1.125% 21 - 15.02.31	185 000	USD	152 471	139 919	0,22
United States 1.125% 21 - 29.02.28	138 000	USD	116 196	111 731	0,18
United States 1.125% 21 - 31.10.26	121 000	USD	105 960	101 082	0,16
United States 1.125% 22 - 15.01.25	118 000	USD	106 743	102 916	0,16
United States 1.25% 20 - 15.05.50	89 000	USD	51 077	43 633	0,07
United States 1.25% 21 - 31.03.28	113 000	USD	97 224	91 746	0,15
United States 1.25% 21 - 30.06.28	115 000	USD	97 599	92 881	0,15
United States 1.25% 21 - 15.08.31	215 000	USD	175 529	161 301	0,26
United States 1.375% 19 - 31.08.26	38 000	USD	33 910	32 067	0,05
United States 1.375% 20 - 31.01.25	34 000	USD	31 847	29 697	0,05
United States 1.375% 20 - 15.08.50	161 000	USD	90 283	81 596	0,13
United States 1.375% 20 - 15.11.40	101 000	USD	67 262	60 845	0,10
United States 1.375% 21 - 31.10.28	157 000	USD	128 188	126 559	0,20
United States 1.375% 21 - 15.11.31	225 000	USD	178 579	169 344	0,27
United States 1.50% 16 - 15.08.26	85 000	USD	77 780	72 018	0,12
United States 1.50% 20 - 31.01.27	136 000	USD	117 437	114 305	0,18
United States 1.50% 20 - 15.02.30	114 000	USD	93 802	89 978	0,14
United States 1.50% 21 - 30.11.28	123 000	USD	100 899	99 586	0,16
United States 1.50% 22 - 15.02.25	83 000	USD	77 616	72 507	0,12
United States 1.625% 16 - 15.02.26	96 000	USD	86 811	82 370	0,13
United States 1.625% 16 - 15.05.26	83 000	USD	74 259	70 899	0,11
United States 1.625% 19 - 15.08.29	80 000	USD	69 981	64 500	0,10
United States 1.625% 19 - 30.09.26	32 000	USD	29 349	27 167	0,04
United States 1.625% 19 - 31.10.26	43 000	USD	38 956	36 445	0,06
United States 1.625% 19 - 30.11.26	34 000	USD	30 411	28 769	0,05
United States 1.625% 20 - 15.11.50	149 000	USD	87 001	80 720	0,13
United States 1.625% 21 - 15.05.31	214 000	USD	174 140	166 363	0,27
United States 1.75% 19 - 15.11.29	74 000	USD	59 466	59 830	0,10
United States 1.75% 19 - 31.12.24	49 000	USD	46 057	43 048	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.75% 19 - 31.12.26	44 000	USD	38 656	37 330	0,06
United States 1.75% 22 - 15.03.25	67 000	USD	64 288	58 606	0,09
United States 1.875% 19 - 30.06.26	77 000	USD	66 936	66 089	0,11
United States 1.875% 19 - 31.07.26	81 000	USD	72 205	69 362	0,11
United States 1.875% 21 - 15.02.51	181 000	USD	114 660	104 405	0,17
United States 1.875% 21 - 15.02.41	126 000	USD	86 525	82 232	0,13
United States 1.875% 21 - 15.11.51	110 000	USD	78 889	63 248	0,10
United States 1.875% 22 - 15.02.32	186 000	USD	157 590	144 938	0,23
United States 2.00% 15 - 15.02.25	128 000	USD	116 566	112 434	0,18
United States 2.00% 15 - 15.08.25	110 000	USD	99 553	95 829	0,15
United States 2.00% 16 - 15.11.26	90 000	USD	82 593	77 044	0,12
United States 2.00% 20 - 15.02.50	87 000	USD	58 119	52 029	0,08
United States 2.00% 21 - 15.08.51	159 000	USD	102 854	94 414	0,15
United States 2.00% 21 - 15.11.41	107 000	USD	72 738	70 302	0,11
United States 2.125% 15 - 15.05.25	79 000	USD	71 496	69 225	0,11
United States 2.125% 19 - 31.05.26	34 000	USD	31 492	29 394	0,05
United States 2.25% 15 - 15.11.25	89 000	USD	81 538	77 598	0,12
United States 2.25% 16 - 15.08.46	60 000	USD	44 610	38 734	0,06
United States 2.25% 17 - 15.02.27	101 000	USD	88 988	86 803	0,14
United States 2.25% 17 - 15.08.27	67 000	USD	62 427	57 203	0,09
United States 2.25% 17 - 15.11.27	106 000	USD	95 847	90 245	0,14
United States 2.25% 18 - 31.12.24	38 000	USD	35 006	33 551	0,05
United States 2.25% 19 - 31.03.26	31 000	USD	28 765	26 923	0,04
United States 2.25% 19 - 15.08.49	57 000	USD	44 900	36 185	0,06
United States 2.25% 22 - 15.02.52	97 000	USD	74 168	61 138	0,10
United States 2.375% 17 - 15.05.27	94 000	USD	86 699	80 827	0,13
United States 2.375% 19 - 30.04.26	20 000	USD	18 160	17 398	0,03
United States 2.375% 19 - 15.05.29	128 000	USD	112 609	107 509	0,17
United States 2.375% 19 - 15.11.49	84 000	USD	58 030	54 774	0,09
United States 2.375% 21 - 15.05.51	173 000	USD	128 021	112 270	0,18
United States 2.50% 15 - 15.02.45	74 000	USD	52 248	50 870	0,08
United States 2.50% 16 - 15.02.46	47 000	USD	37 954	32 017	0,05
United States 2.50% 16 - 15.05.46	64 000	USD	44 839	43 507	0,07
United States 2.50% 18 - 31.01.25	70 000	USD	62 486	61 883	0,10
United States 2.50% 19 - 28.02.26	42 000	USD	39 747	36 696	0,06
United States 2.625% 18 - 31.03.25	16 000	USD	15 222	14 140	0,02
United States 2.625% 18 - 31.12.25	42 000	USD	40 782	36 851	0,06
United States 2.625% 19 - 31.01.26	80 000	USD	73 750	70 147	0,11
United States 2.625% 19 - 15.02.29	95 000	USD	82 053	81 028	0,13
United States 2.625% 22 - 15.04.25	73 000	USD	70 497	64 453	0,10
United States 2.625% 22 - 31.05.27	100 000	USD	92 153	86 679	0,14
United States 2.625% 22 - 31.07.29	51 000	USD	48 216	43 283	0,07
United States 2.75% 12 - 15.08.42	26 000	USD	23 867	19 135	0,03
United States 2.75% 12 - 15.11.42	27 000	USD	23 440	19 813	0,03
United States 2.75% 17 - 15.08.47	65 000	USD	51 689	45 998	0,07
United States 2.75% 17 - 15.11.47	41 000	USD	35 054	28 997	0,05
United States 2.75% 18 - 15.02.28	118 000	USD	104 423	102 114	0,16
United States 2.75% 18 - 28.02.25	41 000	USD	39 223	36 316	0,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.75% 18 - 30.06.25	18 000	USD	17 383	15 898	0,03
United States 2.75% 18 - 31.08.25	45 000	USD	40 497	39 655	0,06
United States 2.75% 22 - 15.05.25	67 000	USD	62 002	59 203	0,09
United States 2.75% 22 - 31.05.29	84 000	USD	75 305	71 860	0,12
United States 2.75% 22 - 15.08.32	215 000	USD	187 486	178 514	0,29
United States 2.875% 13 - 15.05.43	53 000	USD	42 941	39 493	0,06
United States 2.875% 15 - 15.08.45	36 000	USD	31 521	26 357	0,04
United States 2.875% 16 - 15.11.46	28 000	USD	22 485	20 357	0,03
United States 2.875% 18 - 30.04.25	38 000	USD	36 295	33 642	0,05
United States 2.875% 18 - 15.05.28	139 000	USD	127 747	120 720	0,19
United States 2.875% 18 - 31.05.25	59 000	USD	53 064	52 192	0,08
United States 2.875% 18 - 31.07.25	33 000	USD	31 022	29 160	0,05
United States 2.875% 18 - 15.08.28	145 000	USD	132 230	125 644	0,20
United States 2.875% 18 - 30.11.25	52 000	USD	47 650	45 860	0,07
United States 2.875% 19 - 15.05.49	73 000	USD	63 325	52 733	0,08
United States 2.875% 22 - 15.05.32	167 000	USD	150 495	140 313	0,22
United States 2.875% 22 - 15.05.52	130 000	USD	98 719	94 111	0,15
United States 2.875% 22 - 15.06.25	97 000	USD	90 023	85 821	0,14
United States 3.00% 12 - 15.05.42	27 000	USD	23 063	20 738	0,03
United States 3.00% 14 - 15.11.44	60 000	USD	47 607	45 082	0,07
United States 3.00% 15 - 15.05.45	28 000	USD	26 866	20 967	0,03
United States 3.00% 15 - 15.11.45	42 000	USD	34 708	31 367	0,05
United States 3.00% 17 - 15.02.47	67 000	USD	54 985	49 745	0,08
United States 3.00% 17 - 15.05.47	31 000	USD	28 623	23 003	0,04
United States 3.00% 18 - 15.02.48	40 000	USD	32 277	29 613	0,05
United States 3.00% 18 - 15.08.48	103 000	USD	81 774	76 196	0,12
United States 3.00% 18 - 30.09.25	26 000	USD	24 358	22 996	0,04
United States 3.00% 18 - 31.10.25	34 000	USD	30 456	30 062	0,05
United States 3.00% 19 - 15.02.49	97 000	USD	75 423	71 730	0,11
United States 3.00% 22 - 15.07.25	67 000	USD	66 047	59 326	0,10
United States 3.00% 22 - 15.08.52	89 000	USD	75 083	66 167	0,11
United States 3.125% 11 - 15.11.41	21 000	USD	20 874	16 575	0,03
United States 3.125% 12 - 15.02.42	18 000	USD	15 702	14 159	0,02
United States 3.125% 13 - 15.02.43	26 000	USD	23 074	20 172	0,03
United States 3.125% 14 - 15.08.44	99 000	USD	74 085	76 066	0,12
United States 3.125% 18 - 15.05.48	59 000	USD	52 573	44 656	0,07
United States 3.125% 18 - 15.11.28	99 000	USD	95 749	86 624	0,14
United States 3.125% 22 - 15.08.25	61 000	USD	60 785	54 117	0,09
United States 3.125% 22 - 31.08.27	79 000	USD	75 225	69 527	0,11
United States 3.125% 22 - 31.08.29	56 000	USD	52 661	48 746	0,08
United States 3.25% 22 - 30.06.27	94 000	USD	88 509	83 180	0,13
United States 3.25% 22 - 30.06.29	84 000	USD	79 228	73 678	0,12
United States 3.375% 14 - 15.05.44	38 000	USD	32 403	30 401	0,05
United States 3.375% 18 - 15.11.48	76 000	USD	66 594	60 179	0,10
United States 3.375% 22 - 15.08.42	83 000	USD	70 097	67 224	0,11
United States 3.375% 23 - 15.05.33	176 000	USD	154 572	153 153	0,25
United States 3.50% 09 - 15.02.39	27 000	USD	23 633	23 178	0,04
United States 3.50% 22 - 15.09.25	58 000	USD	56 097	51 734	0,08

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.50% 23 - 31.01.28	101 000	USD	91 031	90 046	0,14
United States 3.50% 23 - 31.01.30	75 000	USD	67 287	66 473	0,11
United States 3.50% 23 - 15.02.33	216 000	USD	193 899	189 885	0,30
United States 3.50% 23 - 30.04.30	48 000	USD	44 511	42 509	0,07
United States 3.625% 13 - 15.08.43	72 000	USD	65 189	60 087	0,10
United States 3.625% 14 - 15.02.44	31 000	USD	27 572	25 783	0,04
United States 3.625% 23 - 15.02.53	88 000	USD	78 939	73 875	0,12
United States 3.625% 23 - 31.03.28	89 000	USD	79 681	79 712	0,13
United States 3.625% 23 - 31.03.30	75 000	USD	67 709	66 908	0,11
United States 3.625% 23 - 15.05.26	75 000	USD	69 479	67 120	0,11
United States 3.625% 23 - 15.05.53	89 000	USD	75 722	74 815	0,12
United States 3.625% 23 - 31.05.28	59 000	USD	55 065	52 876	0,08
United States 3.75% 11 - 15.08.41	18 000	USD	16 569	15 541	0,03
United States 3.75% 13 - 15.11.43	38 000	USD	34 117	32 218	0,05
United States 3.75% 23 - 15.04.26	78 000	USD	70 663	69 971	0,11
United States 3.75% 23 - 31.05.30	69 000	USD	62 071	61 975	0,10
United States 3.875% 10 - 15.08.40	25 000	USD	23 606	22 115	0,04
United States 3.875% 22 - 30.09.29	104 000	USD	96 870	94 044	0,15
United States 3.875% 22 - 30.11.27	74 000	USD	72 137	66 874	0,11
United States 3.875% 23 - 31.12.27	62 000	USD	57 607	56 065	0,09
United States 3.875% 23 - 31.12.29	51 000	USD	47 715	46 132	0,07
United States 3.875% 23 - 15.01.26	58 000	USD	53 398	52 112	0,08
United States 3.875% 23 - 30.04.25	58 000	USD	53 991	52 038	0,08
United States 3.875% 23 - 15.05.43	68 000	USD	59 963	58 894	0,09
United States 3.875% 23 - 15.08.33	222 000	USD	196 710	201 031	0,32
United States 4.00% 22 - 31.10.29	74 000	USD	70 852	67 366	0,11
United States 4.00% 22 - 15.11.52	97 000	USD	91 406	86 987	0,14
United States 4.00% 22 - 15.11.42	72 000	USD	65 942	63 550	0,10
United States 4.00% 22 - 15.12.25	53 000	USD	49 966	47 732	0,08
United States 4.00% 23 - 15.02.26	89 000	USD	81 743	80 216	0,13
United States 4.00% 23 - 28.02.30	50 000	USD	47 128	45 532	0,07
United States 4.00% 23 - 30.06.28	57 000	USD	51 309	51 866	0,08
United States 4.00% 23 - 31.07.30	57 000	USD	51 922	51 931	0,08
United States 4.125% 22 - 30.09.27	79 000	USD	77 701	72 008	0,12
United States 4.125% 22 - 31.10.27	75 000	USD	71 819	68 351	0,11
United States 4.125% 22 - 15.11.32	193 000	USD	186 231	177 855	0,28
United States 4.125% 23 - 31.01.25	93 000	USD	84 907	83 677	0,13
United States 4.125% 23 - 15.06.26	60 000	USD	54 526	54 316	0,09
United States 4.125% 23 - 31.07.28	88 000	USD	79 765	80 522	0,13
United States 4.125% 23 - 15.08.53	149 000	USD	126 946	136 950	0,22
United States 4.125% 23 - 31.08.30	79 000	USD	72 518	72 499	0,12
United States 4.25% 09 - 15.05.39	21 000	USD	21 256	19 619	0,03
United States 4.25% 10 - 15.11.40	19 000	USD	21 065	17 566	0,03
United States 4.25% 22 - 15.10.25	66 000	USD	60 612	59 645	0,10
United States 4.25% 23 - 31.05.25	79 000	USD	73 871	71 248	0,11
United States 4.375% 08 - 15.02.38	12 000	USD	13 062	11 433	0,02
United States 4.375% 09 - 15.11.39	22 000	USD	22 537	20 787	0,03
United States 4.375% 10 - 15.05.40	16 000	USD	16 085	15 073	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.375% 11 - 15.05.41	20 000	USD	22 253	18 711	0,03
United States 4.375% 23 - 15.08.26	69 000	USD	63 305	62 912	0,10
United States 4.375% 23 - 31.08.28	78 000	USD	72 969	72 155	0,12
United States 4.375% 23 - 15.08.43	106 000	USD	91 406	98 282	0,16
United States 4.375% 23 - 30.11.28	80 000	USD	73 759	74 181	0,12
United States 4.375% 23 - 30.11.30	50 000	USD	46 405	46 614	0,07
United States 4.375% 23 - 15.12.26	60 000	USD	54 553	54 872	0,09
United States 4.50% 06 - 15.02.36	14 000	USD	14 722	13 537	0,02
United States 4.50% 08 - 15.05.38	11 000	USD	11 945	10 596	0,02
United States 4.50% 09 - 15.08.39	46 000	USD	43 860	44 154	0,07
United States 4.50% 22 - 15.11.25	110 000	USD	103 445	99 921	0,16
United States 4.50% 23 - 15.07.26	81 000	USD	73 715	74 037	0,12
United States 4.50% 23 - 30.09.30	100 000	USD	93 052	94 473	0,15
United States 4.50% 24 - 15.11.33	110 000	USD	103 220	104 714	0,17
United States 4.625% 10 - 15.02.40	19 000	USD	19 948	18 447	0,03
United States 4.625% 23 - 28.02.25	93 000	USD	85 278	84 124	0,13
United States 4.625% 23 - 15.03.26	91 000	USD	84 850	83 113	0,13
United States 4.625% 23 - 15.09.26	75 000	USD	70 518	68 850	0,11
United States 4.625% 23 - 15.10.26	100 000	USD	93 923	91 898	0,15
United States 4.625% 23 - 15.11.26	80 000	USD	73 639	73 587	0,12
United States 4.75% 11 - 15.02.41	23 000	USD	25 194	22 565	0,04
United States 4.75% 23 - 31.07.25	68 000	USD	62 287	61 847	0,10
United States 4.75% 23 - 15.11.43	35 000	USD	32 300	34 095	0,05
United States 4.75% 24 - 15.11.53	83 000	USD	80 348	84 635	0,14
United States 4.875% 23 - 31.10.28	110 000	USD	104 273	103 998	0,17
United States 4.875% 23 - 31.10.30	110 000	USD	103 858	105 460	0,17
United States 4.875% 23 - 30.11.25	115 000	USD	104 596	105 207	0,17
United States 5.00% 07 - 15.05.37	22 000	USD	23 711	22 299	0,04
United States 5.00% 23 - 31.08.25	100 000	USD	94 429	91 375	0,15
United States 5.00% 23 - 31.10.25	106 000	USD	99 826	97 067	0,16
United States 5.25% 98 - 15.11.28	31 000	USD	30 193	29 703	0,05
United States 5.375% 01 - 15.02.31	16 000	USD	17 023	15 842	0,03
United States 6.00% 96 - 15.02.26	29 000	USD	28 535	27 081	0,04
United States 6.125% 97 - 15.11.27	10 000	USD	10 296	9 740	0,02
United States 6.25% 00 - 15.05.30	9 000	USD	9 952	9 200	0,01
			19 792 201	18 821 731	30,12
Total - Obligations			64 388 136	62 026 400	99,26

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds communs de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Dollar Fund-Z-	0	USD	10	10	0,00
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	1	EUR	10 030	10 050	0,01
			10 040	10 060	0,01
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			10 040	10 060	0,01
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			64 398 176	62 036 460	99,27
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			64 398 176	62 036 460	99,27
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				62 510 982	100,03

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 6.25% 97 - 15.07.27	263 000	EUR	295 288	297 271	0,38
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.02.30	379 000	EUR	321 234	327 039	0,42
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.10.40	157 000	EUR	94 964	97 560	0,13
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.02.31	380 000	EUR	312 797	318 592	0,41
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.04.25	207 000	EUR	199 880	199 548	0,26
Austria 144A Zero Coupon 22 - 20.10.28	237 000	EUR	208 963	211 961	0,27
Austria 144A 0.25% 21 - 20.10.36	219 000	EUR	156 070	159 695	0,21
Austria 144A 0.50% 17 - 20.04.27	346 000	EUR	323 367	326 105	0,42
Austria 144A 0.50% 19 - 20.02.29	361 000	EUR	322 982	329 124	0,42
Austria 144A 0.70% 21 - 20.04.71	81 000	EUR	38 028	37 576	0,05
Austria 144A 0.75% 16 - 20.10.26	377 000	EUR	358 390	360 416	0,46
Austria 144A 0.75% 18 - 20.02.28	317 000	EUR	294 293	297 441	0,38
Austria 144A 0.75% 20 - 20.03.51	266 000	EUR	157 977	160 850	0,21
Austria 144A 0.85% 20 - 30.06.20	116 000	EUR	50 175	53 952	0,07
Austria 144A 0.90% 22 - 20.02.32	324 000	EUR	278 459	284 375	0,37
Austria 144A 1.20% 15 - 20.10.25	345 000	EUR	336 475	336 892	0,43
Austria 144A 1.50% 16 - 20.02.47	277 000	EUR	209 125	211 019	0,27
Austria 144A 1.50% 16 - 02.11.86	68 000	EUR	41 726	41 657	0,05
Austria 144A 1.85% 22 - 23.05.49	116 000	EUR	93 477	94 041	0,12
Austria 144A 2.00% 22 - 15.07.26	136 000	EUR	134 289	134 694	0,17
Austria 144A 2.10% 17 - 20.09.17	163 000	EUR	121 248	129 112	0,17
Austria 144A 2.40% 13 - 23.05.34	219 000	EUR	208 412	213 744	0,28
Austria 144A 2.90% 23 - 20.02.33	370 000	EUR	366 522	378 621	0,49
Austria 144A 2.90% 23 - 23.05.29	64 000	EUR	64 501	65 818	0,08
Austria 144A 3.15% 12 - 20.06.44	197 000	EUR	199 927	204 053	0,26
Austria 144A 3.15% 23 - 20.10.53	88 000	EUR	85 103	91 775	0,12
Austria 144A 3.45% 23 - 20.10.30	85 000	EUR	85 966	90 048	0,12
Austria 144A 3.80% 12 - 26.01.62	108 000	EUR	125 949	128 012	0,16
Austria 144A 4.15% 07 - 15.03.37	392 000	EUR	438 073	446 755	0,58
Austria 144A 4.85% 09 - 15.03.26	270 000	EUR	282 845	283 230	0,36
			6 206 505	6 310 976	8,12
Belgique					
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	34 000	EUR	35 482	37 563	0,05
Belgium 4.00% 12 - 28.03.32	27 000	EUR	29 345	29 984	0,04
Belgium 5.50% 98 - 28.03.28	48 000	EUR	53 784	54 236	0,07
Belgium 144A Zero Coupon 20 - 22.10.27	37 000	EUR	33 272	34 022	0,04
Belgium 144A Zero Coupon 21 - 22.10.31	46 000	EUR	35 902	38 019	0,05
Belgium 144A 0.10% 20 - 22.06.30	40 000	EUR	34 027	34 660	0,04
Belgium 144A 0.35% 22 - 22.06.32	50 000	EUR	40 919	41 760	0,05
Belgium 144A 0.40% 20 - 22.06.40	37 000	EUR	24 381	24 638	0,03
Belgium 144A 0.65% 21 - 22.06.71	21 000	EUR	8 918	9 332	0,01
Belgium 144A 0.80% 15 - 22.06.25	60 000	EUR	58 558	58 368	0,08
Belgium 144A 0.80% 17 - 22.06.27	47 000	EUR	44 270	44 735	0,06
Belgium 144A 0.80% 18 - 22.06.28	72 000	EUR	67 154	67 681	0,09
Belgium 144A 0.90% 19 - 22.06.29	60 000	EUR	54 638	55 764	0,07
Belgium 144A 1.00% 15 - 22.06.31	49 000	EUR	43 574	44 237	0,06
Belgium 144A 1.00% 16 - 22.06.26	54 000	EUR	52 314	52 245	0,07
Belgium 144A 1.25% 18 - 22.04.33	30 000	EUR	26 414	26 823	0,03

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.40% 22 - 22.06.53	26 000	EUR	17 526	17 415	0,02
Belgium 144A 1.45% 17 - 22.06.37	28 000	EUR	23 053	23 621	0,03
Belgium 144A 1.60% 16 - 22.06.47	29 000	EUR	21 710	21 805	0,03
Belgium 144A 1.70% 19 - 22.06.50	32 000	EUR	23 202	23 821	0,03
Belgium 144A 1.90% 15 - 22.06.38	11 000	EUR	9 310	9 698	0,01
Belgium 144A 2.15% 16 - 22.06.66	20 000	EUR	13 669	15 744	0,02
Belgium 144A 2.25% 17 - 22.06.57	32 000	EUR	25 621	26 205	0,03
Belgium 144A 2.75% 22 - 22.04.39	12 000	EUR	11 328	11 706	0,02
Belgium 144A 3.00% 14 - 22.06.34	14 000	EUR	13 506	14 398	0,02
Belgium 144A 3.00% 23 - 22.06.33	55 000	EUR	54 426	56 760	0,07
Belgium 144A 3.30% 23 - 22.06.54	33 000	EUR	31 173	33 637	0,04
Belgium 144A 3.45% 23 - 22.06.43	5 000	EUR	5 047	5 269	0,01
Belgium 144A 4.25% 10 - 28.03.41	57 000	EUR	63 246	66 548	0,09
Belgium 144A 4.50% 11 - 28.03.26	32 000	EUR	33 082	33 398	0,04
Belgium 144A 5.00% 04 - 28.03.35	82 000	EUR	96 478	99 687	0,13
			1 085 329	1 113 779	1,43
Finlande					
Finland 144A Zero Coupon 20 - 15.09.30	139 000	EUR	115 488	118 521	0,15
Finland 144A Zero Coupon 21 - 15.09.26	102 000	EUR	95 237	95 637	0,12
Finland 144A 0.125% 20 - 15.04.36	102 000	EUR	72 280	74 428	0,10
Finland 144A 0.125% 21 - 15.04.52	109 000	EUR	52 962	53 534	0,07
Finland 144A 0.125% 21 - 15.09.31	149 000	EUR	122 728	124 640	0,16
Finland 144A 0.25% 20 - 15.09.40	99 000	EUR	64 065	65 544	0,08
Finland 144A 0.50% 16 - 15.04.26	152 000	EUR	144 807	145 443	0,19
Finland 144A 0.50% 17 - 15.09.27	160 000	EUR	147 991	150 069	0,19
Finland 144A 0.50% 18 - 15.09.28	184 000	EUR	165 519	169 015	0,22
Finland 144A 0.50% 19 - 15.09.29	159 000	EUR	140 734	143 599	0,19
Finland 144A 0.50% 22 - 15.04.43	103 000	EUR	66 115	67 266	0,09
Finland 144A 0.75% 15 - 15.04.31	116 000	EUR	100 226	103 174	0,13
Finland 144A 0.875% 15 - 15.09.25	124 000	EUR	120 564	120 474	0,16
Finland 144A 1.125% 18 - 15.04.34	120 000	EUR	101 837	104 118	0,13
Finland 144A 1.375% 17 - 15.04.47	144 000	EUR	107 552	109 123	0,14
Finland 144A 1.375% 22 - 15.04.27	101 000	EUR	96 979	97 881	0,13
Finland 144A 1.50% 22 - 15.09.32	139 000	EUR	124 506	127 976	0,16
Finland 144A 2.625% 12 - 04.07.42	130 000	EUR	122 840	126 302	0,16
Finland 144A 2.75% 12 - 04.07.28	124 000	EUR	124 344	126 339	0,16
Finland 144A 2.75% 23 - 15.04.38	99 000	EUR	93 125	98 465	0,13
Finland 144A 2.875% 23 - 15.04.29	70 000	EUR	69 994	71 827	0,09
Finland 144A 3.00% 23 - 15.09.33	147 000	EUR	145 769	152 136	0,20
Finland 144A 4.00% 09 - 04.07.25	132 000	EUR	134 745	134 339	0,17
			2 530 407	2 579 850	3,32
France					
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	734 000	EUR	711 041	708 897	0,91
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	729 000	EUR	627 804	639 187	0,82
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	700 000	EUR	662 955	665 560	0,86
France OAT Zero Coupon 20 - 25.11.30	871 000	EUR	727 155	744 357	0,96
France OAT Zero Coupon 21 - 25.11.31	831 000	EUR	673 929	689 647	0,89
France OAT Zero Coupon 21 - 25.02.27	633 000	EUR	584 868	590 019	0,76

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 22 - 25.05.32	566 000	EUR	452 701	462 592	0,60
France OAT Zero Coupon 22 - 25.02.25	470 000	EUR	455 410	454 725	0,58
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	607 000	EUR	568 540	573 069	0,74
France OAT 0.50% 15 - 25.05.25	699 000	EUR	677 680	678 240	0,87
France OAT 0.50% 16 - 25.05.26	784 000	EUR	746 787	750 445	0,97
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	866 000	EUR	778 077	790 225	1,02
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	971 000	EUR	899 187	911 575	1,17
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	908 000	EUR	833 267	846 347	1,09
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	519 000	EUR	292 012	297 283	0,38
France OAT 0.75% 22 - 25.02.28	753 000	EUR	696 537	709 251	0,91
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	582 000	EUR	564 545	566 344	0,73
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	637 000	EUR	604 932	611 201	0,79
France OAT 1.25% 18 - 25.05.34	695 000	EUR	594 393	610 140	0,79
France OAT 1.25% 22 - 25.05.38	253 000	EUR	195 821	205 765	0,26
France OAT 1.50% 15 - 25.05.31	950 000	EUR	881 745	896 325	1,15
France OAT 2.00% 22 - 25.11.32	706 000	EUR	659 799	679 313	0,87
France OAT 2.50% 14 - 25.05.30	968 000	EUR	962 002	979 809	1,26
France OAT 2.50% 23 - 24.09.26	731 000	EUR	722 919	733 778	0,94
France OAT 2.75% 12 - 25.10.27	886 000	EUR	891 443	902 036	1,16
France OAT 2.75% 23 - 25.02.29	513 000	EUR	510 470	525 107	0,68
France OAT 3.00% 23 - 25.05.33	580 000	EUR	578 275	602 968	0,78
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	459 000	EUR	466 366	478 783	0,62
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	678 000	EUR	690 641	694 747	0,89
France OAT 3.50% 23 - 25.11.33	232 000	EUR	237 387	250 722	0,32
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	413 000	EUR	458 877	471 976	0,61
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	307 000	EUR	359 551	367 080	0,47
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	590 000	EUR	695 046	719 151	0,93
France OAT 4.75% 04 - 25.04.35	445 000	EUR	519 019	535 157	0,69
France OAT 5.50% 98 - 25.04.29	608 000	EUR	694 794	704 064	0,91
France OAT 5.75% 01 - 25.10.32	540 000	EUR	664 968	677 970	0,87
France OAT 6.00% 94 - 25.10.25	470 000	EUR	496 802	498 529	0,64
France OAT 144A 0.50% 20 - 25.05.40	390 000	EUR	262 501	269 919	0,35
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.05.72	203 000	EUR	80 963	84 265	0,11
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.06.44	356 000	EUR	216 254	222 927	0,29
France OAT 144A 0.75% 21 - 25.05.53	478 000	EUR	261 860	268 206	0,34
France OAT 144A 1.25% 16 - 25.05.36	722 000	EUR	591 189	610 379	0,79
France OAT 144A 1.50% 19 - 25.05.50	504 000	EUR	358 645	366 005	0,47
France OAT 144A 1.75% 16 - 25.05.66	258 000	EUR	179 004	183 825	0,24
France OAT 144A 1.75% 17 - 25.06.39	504 000	EUR	424 508	437 926	0,56
France OAT 144A 2.00% 17 - 25.05.48	470 000	EUR	380 674	388 643	0,50
France OAT 144A 2.50% 22 - 25.05.43	209 000	EUR	182 961	194 370	0,25
France OAT 144A 3.00% 23 - 25.05.54	336 000	EUR	305 269	329 717	0,42
France OAT 144A 4.00% 05 - 25.04.55	309 000	EUR	358 075	364 589	0,47
			26 439 648	26 943 155	34,68
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	643 000	EUR	605 831	608 458	0,78

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 19 - 15.08.29	584 000	EUR	518 416	525 921	0,68
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	782 000	EUR	431 742	435 637	0,56
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	554 000	EUR	485 408	493 420	0,63
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	415 000	EUR	402 466	400 911	0,52
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	459 000	EUR	352 315	361 256	0,46
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	435 000	EUR	398 547	403 262	0,52
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	659 000	EUR	572 129	582 101	0,75
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	544 000	EUR	520 402	521 500	0,67
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	210 000	EUR	184 188	185 214	0,24
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	157 000	EUR	150 919	150 737	0,19
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.02.31	545 000	EUR	466 786	476 335	0,61
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	554 000	EUR	525 825	526 965	0,68
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.05.36	507 000	EUR	378 780	388 448	0,50
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.11.28	526 000	EUR	474 134	479 786	0,62
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	198 000	EUR	111 228	110 793	0,14
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	594 000	EUR	505 414	513 745	0,66
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	475 000	EUR	446 049	447 972	0,58
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	580 000	EUR	305 343	309 099	0,40
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	209 000	EUR	178 254	180 597	0,23
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.02.32	610 000	EUR	510 607	521 422	0,67
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 16.04.27	435 000	EUR	403 492	407 234	0,52
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.10.27	594 000	EUR	573 845	579 708	0,75
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	607 000	EUR	572 451	574 386	0,74
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	564 000	EUR	516 481	523 274	0,67
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	570 000	EUR	517 366	524 959	0,68
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	589 000	EUR	576 097	573 651	0,74

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 0.50% 16 - 15.02.26	663 000	EUR	638 515	638 602	0,82
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	643 000	EUR	603 740	610 136	0,79
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	564 000	EUR	528 207	532 433	0,69
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	603 000	EUR	588 838	588 425	0,76
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 22 - 15.05.38	433 000	EUR	359 044	367 877	0,47
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	737 000	EUR	594 976	598 672	0,77
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	158 000	EUR	151 392	154 439	0,20
Bundesrepublik Deutschland 1.70% 22 - 15.08.32	550 000	EUR	526 903	538 059	0,69
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 22 - 15.08.53	517 000	EUR	435 928	466 174	0,60
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	104 000	EUR	90 458	93 987	0,12
Bundesrepublik Deutschland 2.10% 22 - 15.11.29	514 000	EUR	505 628	518 816	0,67
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 23 - 13.04.28	495 000	EUR	491 467	499 490	0,64
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	740 000	EUR	735 488	758 211	0,98
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	145 000	EUR	144 434	148 495	0,19
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 19.10.28	576 000	EUR	571 977	587 687	0,76
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 15.11.30	253 000	EUR	253 082	260 312	0,33
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 04.07.44	602 000	EUR	615 557	621 932	0,80
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	623 000	EUR	645 062	646 967	0,83
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	346 000	EUR	344 169	344 626	0,44
Bundesrepublik Deutschland 2.60% 23 - 15.08.33	600 000	EUR	604 061	629 394	0,81
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	346 000	EUR	345 532	346 626	0,45
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	336 000	EUR	336 163	339 242	0,44
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	319 000	EUR	321 771	323 144	0,42
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 04.07.42	386 000	EUR	436 394	440 824	0,57
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 04.01.37	551 000	EUR	649 805	662 533	0,85
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 04.07.39	380 000	EUR	467 340	478 105	0,62
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 04.07.28	272 000	EUR	300 753	303 579	0,39
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 04.07.34	492 000	EUR	602 994	614 966	0,79
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 08 - 04.07.40	424 000	EUR	560 112	567 176	0,73
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 04.01.31	422 000	EUR	509 795	518 385	0,67
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 04.01.28	336 000	EUR	378 441	382 008	0,49
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 04.01.30	232 000	EUR	283 953	287 576	0,37
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 04.07.27	272 000	EUR	310 037	311 894	0,40
			26 616 531	26 987 583	34,74
Irlande					
Ireland Zero Coupon 21 - 18.10.31	74 000	EUR	60 287	61 849	0,08
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	63 000	EUR	58 227	58 911	0,08
Ireland 0.20% 20 - 18.10.30	55 000	EUR	46 912	47 795	0,06
Ireland 0.35% 22 - 18.10.32	42 000	EUR	33 953	35 263	0,05
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	40 000	EUR	30 237	31 632	0,04
Ireland 0.55% 21 - 22.04.41	38 000	EUR	25 153	26 478	0,03
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	68 000	EUR	63 480	64 287	0,08
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	94 000	EUR	90 513	91 143	0,12
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	83 000	EUR	76 725	78 277	0,10
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	44 000	EUR	38 589	39 851	0,05
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	56 000	EUR	50 920	52 545	0,07
Ireland 1.50% 19 - 15.05.50	74 000	EUR	52 806	55 441	0,07
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	56 000	EUR	47 837	49 840	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	90 000	EUR	73 970	77 436	0,10
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	87 000	EUR	85 925	87 687	0,11
Ireland 3.00% 23 - 18.10.43	24 000	EUR	21 797	24 814	0,03
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	85 000	EUR	87 502	87 261	0,11
			944 833	970 510	1,25
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.07.30	500 000	EUR	424 861	433 850	0,56
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.27	505 000	EUR	468 720	472 225	0,61
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.52	618 000	EUR	304 968	316 910	0,41
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.07.31	525 000	EUR	434 181	444 675	0,57
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.38	386 000	EUR	262 740	272 246	0,35
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.29	403 000	EUR	355 520	361 693	0,47
Netherlands 144A Zero Coupon 22 - 15.01.26	475 000	EUR	449 601	451 532	0,58
Netherlands 144A 0.25% 15 - 15.07.25	685 000	EUR	660 048	661 162	0,85
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	456 000	EUR	402 834	410 947	0,53
Netherlands 144A 0.50% 16 - 15.07.26	695 000	EUR	660 671	664 559	0,85
Netherlands 144A 0.50% 19 - 15.01.40	508 000	EUR	365 299	375 361	0,48
Netherlands 144A 0.50% 22 - 15.07.32	475 000	EUR	400 156	408 357	0,53
Netherlands 144A 0.75% 17 - 15.07.27	656 000	EUR	616 941	624 250	0,80
Netherlands 144A 0.75% 18 - 15.07.28	700 000	EUR	646 728	657 510	0,85
Netherlands 144A 2.00% 22 - 15.01.54	296 000	EUR	252 958	266 459	0,34
Netherlands 144A 2.50% 12 - 15.01.33	502 000	EUR	498 314	508 777	0,65
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.07.33	453 000	EUR	435 900	458 074	0,59
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.01.30	250 000	EUR	246 932	254 275	0,33
Netherlands 144A 2.75% 14 - 15.01.47	711 000	EUR	721 310	743 422	0,96
Netherlands 144A 3.25% 23 - 15.01.44	168 000	EUR	165 756	186 592	0,24
Netherlands 144A 3.75% 10 - 15.01.42	674 000	EUR	766 080	793 028	1,02
Netherlands 144A 4.00% 05 - 15.01.37	604 000	EUR	683 677	703 479	0,91
Netherlands 144A 5.50% 98 - 15.01.28	430 000	EUR	478 173	483 621	0,62
			10 702 368	10 953 004	14,10
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	26 000	EUR	25 257	25 146	0,03
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	23 000	EUR	21 634	21 758	0,03
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	18 000	EUR	16 023	16 248	0,02
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.27	2 000	EUR	1 830	1 850	0,00
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	15 000	EUR	14 407	14 393	0,02
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	39 000	EUR	34 475	35 341	0,05
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	16 000	EUR	15 931	16 060	0,02
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	26 000	EUR	31 046	31 671	0,04
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	16 000	EUR	18 343	18 572	0,02
Spain 144A 0.10% 21 - 30.04.31	16 000	EUR	12 894	13 213	0,02
Spain 144A 0.50% 20 - 30.04.30	3 000	EUR	2 594	2 625	0,00
Spain 144A 0.50% 21 - 31.10.31	32 000	EUR	26 311	26 891	0,03
Spain 144A 0.60% 19 - 31.10.29	38 000	EUR	33 435	33 875	0,04
Spain 144A 0.70% 22 - 30.04.32	25 000	EUR	20 457	21 077	0,03
Spain 144A 0.80% 20 - 30.07.27	29 000	EUR	27 044	27 282	0,04
Spain 144A 0.85% 21 - 30.07.37	12 000	EUR	8 383	8 814	0,01
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	42 000	EUR	23 214	23 536	0,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.00% 21 - 30.07.42	10 000	EUR	6 289	6 671	0,01
Spain 144A 1.20% 20 - 31.10.40	40 000	EUR	27 267	28 508	0,04
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	33 000	EUR	29 098	30 004	0,04
Spain 144A 1.30% 16 - 31.10.26	44 000	EUR	42 103	42 489	0,05
Spain 144A 1.40% 18 - 30.04.28	45 000	EUR	42 367	42 910	0,06
Spain 144A 1.40% 18 - 30.07.28	21 000	EUR	19 439	19 960	0,03
Spain 144A 1.45% 17 - 31.10.27	8 000	EUR	7 595	7 686	0,01
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	17 000	EUR	15 674	16 047	0,02
Spain 144A 1.45% 21 - 31.10.71	15 000	EUR	7 334	7 340	0,01
Spain 144A 1.50% 17 - 30.04.27	35 000	EUR	33 644	33 836	0,04
Spain 144A 1.60% 15 - 30.04.25	18 000	EUR	17 649	17 671	0,02
Spain 144A 1.85% 19 - 30.07.35	33 000	EUR	28 018	28 877	0,04
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	11 000	EUR	7 202	7 600	0,01
Spain 144A 1.95% 15 - 30.07.30	35 000	EUR	32 678	33 448	0,04
Spain 144A 1.95% 16 - 30.04.26	19 000	EUR	18 667	18 700	0,02
Spain 144A 2.15% 15 - 31.10.25	34 000	EUR	33 396	33 644	0,04
Spain 144A 2.35% 17 - 30.07.33	31 000	EUR	28 702	29 448	0,04
Spain 144A 2.55% 22 - 31.10.32	25 000	EUR	23 641	24 354	0,03
Spain 144A 2.70% 18 - 31.10.48	10 000	EUR	8 429	8 577	0,01
Spain 144A 2.90% 16 - 31.10.46	30 000	EUR	26 478	27 035	0,03
Spain 144A 3.15% 23 - 30.04.33	20 000	EUR	19 621	20 317	0,03
Spain 144A 3.45% 16 - 30.07.66	11 000	EUR	10 027	10 152	0,01
Spain 144A 3.45% 22 - 30.07.43	19 000	EUR	17 975	18 810	0,02
Spain 144A 3.50% 23 - 31.05.29	10 000	EUR	10 027	10 437	0,01
Spain 144A 3.55% 23 - 31.10.33	22 000	EUR	21 900	23 022	0,03
Spain 144A 3.90% 23 - 30.07.39	13 000	EUR	12 988	13 765	0,02
Spain 144A 4.20% 05 - 31.01.37	20 000	EUR	21 586	22 064	0,03
Spain 144A 4.65% 10 - 30.07.25	44 000	EUR	45 508	45 163	0,06
Spain 144A 4.70% 09 - 30.07.41	26 000	EUR	29 469	30 309	0,04
Spain 144A 4.90% 07 - 30.07.40	4 000	EUR	4 653	4 722	0,01
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.28	25 000	EUR	27 530	27 905	0,04
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.44	10 000	EUR	12 148	12 401	0,02
Spain 144A 5.90% 11 - 30.07.26	35 000	EUR	37 657	37 794	0,05
			1 060 037	1 080 018	1,39
Total - Obligations			75 585 658	76 938 875	99,03

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	2	EUR	20 020	20 099	0,02
			20 020	20 099	0,02
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			20 020	20 099	0,02
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			75 605 678	76 958 974	99,05
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			75 605 678	76 958 974	99,05
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				77 694 469	100,00

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

Xtrackers II

Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
États-Unis					
United States Zero Coupon 20 - 15.10.25	103 163	USD	99 216	99 150	2,32
United States Zero Coupon 21 - 15.10.26	109 217	USD	103 545	103 748	2,43
United States Zero Coupon 22 - 15.01.32	140 961	USD	124 637	124 012	2,91
United States Zero Coupon 22 - 15.02.52	54 157	USD	34 789	33 458	0,78
United States Zero Coupon 22 - 15.04.27	108 971	USD	102 318	102 424	2,40
United States Zero Coupon 22 - 15.07.32	130 251	USD	119 897	119 210	2,80
United States Zero Coupon 22 - 15.10.27	103 864	USD	102 821	103 109	2,42
United States Zero Coupon 23 - 15.01.33	128 080	USD	122 281	121 426	2,85
United States Zero Coupon 23 - 15.02.53	51 753	USD	47 901	47 164	1,11
United States 0.125% 16 - 15.07.26	118 089	USD	112 419	112 499	2,64
United States 0.125% 20 - 15.04.25	107 204	USD	103 619	103 376	2,42
United States 0.125% 20 - 15.07.30	128 402	USD	116 258	116 074	2,72
United States 0.125% 21 - 15.01.31	126 467	USD	113 326	112 922	2,65
United States 0.125% 21 - 15.02.51	54 361	USD	35 544	33 861	0,79
United States 0.125% 21 - 15.04.26	118 494	USD	112 670	112 764	2,64
United States 0.125% 21 - 15.07.31	136 606	USD	121 860	121 675	2,85
United States 0.25% 15 - 15.01.25	131 200	USD	127 688	127 356	2,99
United States 0.25% 19 - 15.07.29	119 079	USD	109 911	110 176	2,58
United States 0.25% 20 - 15.02.50	45 476	USD	31 142	29 801	0,70
United States 0.375% 15 - 15.07.25	132 337	USD	128 306	128 202	3,01
United States 0.375% 17 - 15.01.27	122 275	USD	116 051	116 247	2,73
United States 0.375% 17 - 15.07.27	114 457	USD	108 515	108 797	2,55
United States 0.50% 18 - 15.01.28	119 745	USD	113 161	113 364	2,66
United States 0.625% 13 - 15.02.43	77 617	USD	62 800	60 905	1,43
United States 0.625% 16 - 15.01.26	137 256	USD	132 451	132 410	3,10
United States 0.75% 12 - 15.02.42	77 613	USD	64 989	63 211	1,48
United States 0.75% 15 - 15.02.45	75 782	USD	61 572	59 582	1,40
United States 0.75% 18 - 15.07.28	113 992	USD	108 968	109 183	2,56
United States 0.875% 17 - 15.02.47	61 180	USD	50 261	48 494	1,14
United States 0.875% 19 - 15.01.29	109 665	USD	104 749	105 047	2,46
United States 1.00% 16 - 15.02.46	64 926	USD	55 071	53 410	1,25
United States 1.00% 18 - 15.02.48	58 641	USD	48 953	47 581	1,12
United States 1.25% 23 - 15.04.28	101 550	USD	98 805	98 956	2,32
United States 1.375% 14 - 15.02.44	75 249	USD	69 140	67 558	1,58
United States 1.375% 23 - 15.07.33	121 567	USD	115 728	118 025	2,77
United States 1.375% 23 - 15.07.33	124 369	USD	112 877	112 807	2,64
United States 1.50% 23 - 15.02.53	47 685	USD	40 016	38 572	0,90
United States 1.75% 08 - 15.01.28	58 746	USD	58 290	58 397	1,37
United States 2.00% 06 - 15.01.26	77 509	USD	76 861	76 879	1,80
United States 2.125% 10 - 15.02.40	54 093	USD	56 829	55 749	1,31
United States 2.125% 11 - 15.02.41	85 703	USD	89 773	88 361	2,07
United States 2.375% 04 - 15.01.25	112 626	USD	111 947	111 737	2,62
United States 2.375% 07 - 15.01.27	64 079	USD	64 500	64 674	1,52
United States 2.375% 23 - 15.10.28	105 470	USD	107 141	108 691	2,55
United States 2.50% 09 - 15.01.29	51 590	USD	53 150	53 363	1,25
United States 3.375% 01 - 15.04.32	22 534	USD	25 330	25 256	0,59

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.625% 98 - 15.04.28	81 798	USD	87 297	87 626	2,05
United States 3.875% 99 - 15.04.29	93 579	USD	102 707	103 237	2,42
			4 268 080	4 250 526	99,65
Total - Obligations			4 268 080	4 250 526	99,65
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Dollar Fund-Z-	0	USD	11	11	0,00
			11	11	0,00
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			11	11	0,00
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			4 268 091	4 250 537	99,65
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			4 268 091	4 250 537	99,65
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				4 265 209	99,99

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

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.85% 22 - 23.05.49	189 000	EUR	149 989	154 317	2,37
Austria 144A 2.90% 23 - 23.05.29	108 000	EUR	108 376	111 045	1,71
			258 365	265 362	4,08
Belgique					
Belgium 144A 1.25% 18 - 22.04.33	407 000	EUR	356 605	363 976	5,59
Belgium 144A 2.75% 22 - 22.04.39	193 000	EUR	185 255	188 368	2,89
			541 860	552 344	8,48
France					
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.06.44	803 000	EUR	493 142	504 790	7,75
France OAT 144A 1.75% 17 - 25.06.39	1 183 000	EUR	1 007 809	1 030 890	15,83
			1 500 951	1 535 680	23,58
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	342 000	EUR	297 586	301 873	4,64
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	268 000	EUR	256 739	257 628	3,96
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.50	360 000	EUR	205 564	201 458	3,09
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	324 000	EUR	275 712	280 514	4,31
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	288 000	EUR	277 497	281 915	4,33
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	198 000	EUR	168 725	179 331	2,75
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	225 000	EUR	223 600	231 052	3,55
			1 705 423	1 733 771	26,63
Irlande					
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	246 000	EUR	227 050	230 871	3,54
Ireland 3.00% 23 - 18.10.43	126 000	EUR	121 506	130 055	2,00
			348 556	360 926	5,54
Italie					
Italy 144A 1.50% 21 - 30.04.45	486 000	EUR	305 211	307 056	4,72
Italy 144A 4.00% 22 - 30.04.35	428 000	EUR	419 973	435 756	6,69
Italy 144A 4.00% 23 - 30.10.31	360 000	EUR	360 516	375 002	5,76
			1 085 700	1 117 814	17,17
Pays-Bas					
Netherlands 144A 0.50% 19 - 15.01.40	565 000	EUR	412 625	418 919	6,44
Netherlands 144A 3.25% 23 - 15.01.44	179 000	EUR	177 637	199 343	3,06
			590 262	618 262	9,50
Espagne					
Spain 144A 1.00% 21 - 30.07.42	416 000	EUR	268 819	279 323	4,29
			268 819	279 323	4,29
Total - Obligations			6 299 936	6 463 482	99,27
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			6 299 936	6 463 482	99,27
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			6 299 936	6 463 482	99,27
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				6 510 701	99,99

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 6.25% 97 - 15.07.27	180 000	EUR	201 751	203 423	0,19
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.02.30	276 000	EUR	233 375	238 276	0,22
Austria 144A Zero Coupon 20 - 20.10.40	125 000	EUR	74 760	78 134	0,07
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.02.31	310 000	EUR	253 889	259 989	0,24
Austria 144A Zero Coupon 21 - 20.04.25	171 000	EUR	164 748	165 000	0,15
Austria 144A Zero Coupon 22 - 20.10.28	200 000	EUR	175 273	178 899	0,16
Austria 144A 0.25% 21 - 20.10.36	116 000	EUR	81 440	84 904	0,08
Austria 144A 0.50% 17 - 20.04.27	306 000	EUR	285 693	288 346	0,26
Austria 144A 0.50% 19 - 20.02.29	295 000	EUR	264 146	268 710	0,25
Austria 144A 0.70% 21 - 20.04.71	71 000	EUR	33 005	33 762	0,03
Austria 144A 0.75% 16 - 20.10.26	286 000	EUR	271 776	273 452	0,25
Austria 144A 0.75% 18 - 20.02.28	245 000	EUR	226 727	229 997	0,21
Austria 144A 0.75% 20 - 20.03.51	195 000	EUR	115 856	118 594	0,11
Austria 144A 0.85% 20 - 30.06.20	97 000	EUR	42 238	44 992	0,04
Austria 144A 0.90% 22 - 20.02.32	203 000	EUR	174 409	178 179	0,16
Austria 144A 1.20% 15 - 20.10.25	274 000	EUR	267 031	267 666	0,25
Austria 144A 1.50% 16 - 20.02.47	198 000	EUR	148 390	151 892	0,14
Austria 144A 1.50% 16 - 02.11.86	56 000	EUR	34 290	35 112	0,03
Austria 144A 1.85% 22 - 23.05.49	101 000	EUR	77 737	82 466	0,08
Austria 144A 2.00% 22 - 15.07.26	97 000	EUR	95 406	96 028	0,09
Austria 144A 2.10% 17 - 20.09.17	129 000	EUR	96 612	100 572	0,09
Austria 144A 2.40% 13 - 23.05.34	197 000	EUR	186 148	192 796	0,18
Austria 144A 2.90% 23 - 20.02.33	298 000	EUR	293 511	305 269	0,28
Austria 144A 2.90% 23 - 23.05.29	55 000	EUR	55 282	56 551	0,05
Austria 144A 3.15% 12 - 20.06.44	176 000	EUR	177 078	183 330	0,17
Austria 144A 3.15% 23 - 20.10.53	72 000	EUR	69 456	75 185	0,07
Austria 144A 3.45% 23 - 20.10.30	91 000	EUR	92 188	96 366	0,09
Austria 144A 3.80% 12 - 26.01.62	80 000	EUR	93 008	95 644	0,09
Austria 144A 4.15% 07 - 15.03.37	320 000	EUR	357 546	366 694	0,34
Austria 144A 4.85% 09 - 15.03.26	226 000	EUR	236 471	237 257	0,22
			4 879 240	4 987 485	4,59
Belgique					
Belgium 3.75% 13 - 22.06.45	160 000	EUR	172 838	176 872	0,16
Belgium 4.00% 12 - 28.03.32	161 000	EUR	175 132	178 890	0,16
Belgium 5.50% 98 - 28.03.28	342 000	EUR	380 773	386 349	0,36
Belgium 144A Zero Coupon 20 - 22.10.27	180 000	EUR	162 883	165 508	0,15
Belgium 144A Zero Coupon 21 - 22.10.31	224 000	EUR	180 615	185 229	0,17
Belgium 144A 0.10% 20 - 22.06.30	227 000	EUR	192 591	196 830	0,18
Belgium 144A 0.35% 22 - 22.06.32	261 000	EUR	212 526	218 182	0,20
Belgium 144A 0.40% 20 - 22.06.40	147 000	EUR	93 776	97 955	0,09
Belgium 144A 0.65% 21 - 22.06.71	130 000	EUR	55 494	58 666	0,05
Belgium 144A 0.80% 15 - 22.06.25	346 000	EUR	336 384	336 582	0,31
Belgium 144A 0.80% 17 - 22.06.27	242 000	EUR	227 466	230 281	0,21
Belgium 144A 0.80% 18 - 22.06.28	282 000	EUR	261 577	265 063	0,24
Belgium 144A 0.90% 19 - 22.06.29	243 000	EUR	222 209	225 951	0,21
Belgium 144A 1.00% 15 - 22.06.31	262 000	EUR	231 743	236 624	0,22
Belgium 144A 1.00% 16 - 22.06.26	263 000	EUR	252 354	254 484	0,23
Belgium 144A 1.25% 18 - 22.04.33	160 000	EUR	139 851	143 086	0,13

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.40% 22 - 22.06.53	172 000	EUR	111 868	115 239	0,11
Belgium 144A 1.45% 17 - 22.06.37	123 000	EUR	99 429	103 886	0,10
Belgium 144A 1.60% 16 - 22.06.47	157 000	EUR	115 018	118 151	0,11
Belgium 144A 1.70% 19 - 22.06.50	161 000	EUR	116 888	119 961	0,11
Belgium 144A 1.90% 15 - 22.06.38	130 000	EUR	110 894	114 750	0,11
Belgium 144A 2.15% 16 - 22.06.66	108 000	EUR	84 666	85 525	0,08
Belgium 144A 2.25% 17 - 22.06.57	110 000	EUR	89 357	90 467	0,08
Belgium 144A 2.75% 22 - 22.04.39	59 000	EUR	55 133	57 584	0,05
Belgium 144A 3.00% 14 - 22.06.34	158 000	EUR	158 010	162 663	0,15
Belgium 144A 3.00% 23 - 22.06.33	288 000	EUR	284 403	297 433	0,27
Belgium 144A 3.30% 23 - 22.06.54	181 000	EUR	169 319	184 611	0,17
Belgium 144A 3.45% 23 - 22.06.43	70 000	EUR	70 870	73 994	0,07
Belgium 144A 4.25% 10 - 28.03.41	274 000	EUR	310 351	320 286	0,30
Belgium 144A 4.50% 11 - 28.03.26	165 000	EUR	171 627	172 280	0,16
Belgium 144A 5.00% 04 - 28.03.35	274 000	EUR	323 656	333 482	0,31
			5 569 701	5 706 864	5,25
Croatie					
Croatia 1.125% 19 - 19.06.29	100 000	EUR	89 868	90 676	0,09
Croatia 1.50% 20 - 17.06.31	100 000	EUR	84 478	89 440	0,08
			174 346	180 116	0,17
Chypre					
Cyprus Zero Coupon 21 - 09.02.26	9 000	EUR	8 354	8 503	0,01
Cyprus 0.625% 19 - 03.12.24	9 000	EUR	8 799	8 752	0,01
Cyprus 0.625% 20 - 21.01.30	9 000	EUR	7 438	7 908	0,01
Cyprus 0.95% 22 - 20.01.32	9 000	EUR	7 001	7 733	0,01
Cyprus 1.25% 20 - 21.01.40	11 000	EUR	7 521	7 953	0,01
Cyprus 1.50% 20 - 16.04.27	13 000	EUR	12 245	12 496	0,01
Cyprus 2.375% 18 - 25.09.28	23 000	EUR	21 888	22 580	0,02
Cyprus 2.75% 19 - 26.02.34	10 000	EUR	8 908	9 514	0,01
Cyprus 2.75% 19 - 03.05.49	9 000	EUR	7 072	7 557	0,00
Cyprus 4.125% 23 - 13.04.33	13 000	EUR	13 199	14 051	0,01
Cyprus 4.25% 15 - 04.11.25	9 000	EUR	9 171	9 243	0,01
			111 596	116 290	0,11
Estonie					
Estonia 0.125% 20 - 10.06.30	16 000	EUR	13 092	13 271	0,01
Estonia 4.00% 22 - 12.10.32	20 000	EUR	20 440	21 530	0,02
			33 532	34 801	0,03
Finlande					
Finland 144A Zero Coupon 20 - 15.09.30	131 000	EUR	109 010	111 866	0,10
Finland 144A Zero Coupon 21 - 15.09.26	78 000	EUR	72 698	73 096	0,07
Finland 144A 0.125% 20 - 15.04.36	109 000	EUR	78 229	79 663	0,07
Finland 144A 0.125% 21 - 15.04.52	91 000	EUR	45 786	44 803	0,04
Finland 144A 0.125% 21 - 15.09.31	130 000	EUR	106 451	109 005	0,10
Finland 144A 0.25% 20 - 15.09.40	86 000	EUR	55 500	56 975	0,05
Finland 144A 0.50% 16 - 15.04.26	134 000	EUR	127 765	128 170	0,12
Finland 144A 0.50% 17 - 15.09.27	133 000	EUR	123 104	124 654	0,12
Finland 144A 0.50% 18 - 15.09.28	152 000	EUR	137 348	139 423	0,13
Finland 144A 0.50% 19 - 15.09.29	141 000	EUR	124 543	127 489	0,12

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 0.50% 22 - 15.04.43	88 000	EUR	55 932	57 613	0,05
Finland 144A 0.75% 15 - 15.04.31	106 000	EUR	92 006	94 344	0,09
Finland 144A 0.875% 15 - 15.09.25	105 000	EUR	101 604	102 122	0,09
Finland 144A 1.125% 18 - 15.04.34	102 000	EUR	85 638	88 504	0,08
Finland 144A 1.375% 17 - 15.04.47	123 000	EUR	92 321	93 351	0,09
Finland 144A 1.375% 22 - 15.04.27	92 000	EUR	88 264	88 968	0,08
Finland 144A 1.50% 22 - 15.09.32	127 000	EUR	114 494	117 138	0,11
Finland 144A 2.625% 12 - 04.07.42	109 000	EUR	103 688	105 956	0,10
Finland 144A 2.75% 12 - 04.07.28	120 000	EUR	120 167	121 980	0,11
Finland 144A 2.75% 23 - 15.04.38	85 000	EUR	79 556	84 602	0,08
Finland 144A 2.875% 23 - 15.04.29	65 000	EUR	64 821	66 725	0,06
Finland 144A 3.00% 23 - 15.09.33	127 000	EUR	126 151	131 550	0,12
Finland 144A 4.00% 09 - 04.07.25	117 000	EUR	119 363	119 234	0,11
			2 224 439	2 267 231	2,09
France					
France OAT Zero Coupon 19 - 25.03.25	772 000	EUR	746 205	745 721	0,69
France OAT Zero Coupon 19 - 25.11.29	742 000	EUR	639 802	651 283	0,60
France OAT Zero Coupon 20 - 25.02.26	740 000	EUR	699 510	703 659	0,65
France OAT Zero Coupon 20 - 25.11.30	914 000	EUR	764 011	781 333	0,72
France OAT Zero Coupon 21 - 25.11.31	843 000	EUR	684 020	701 081	0,65
France OAT Zero Coupon 21 - 25.02.27	619 000	EUR	571 148	576 964	0,53
France OAT Zero Coupon 22 - 25.05.32	536 000	EUR	428 931	439 225	0,40
France OAT Zero Coupon 22 - 25.02.25	519 000	EUR	502 294	502 190	0,46
France OAT 0.25% 16 - 25.11.26	642 000	EUR	600 653	606 196	0,56
France OAT 0.50% 15 - 25.05.25	664 000	EUR	643 526	644 080	0,59
France OAT 0.50% 16 - 25.05.26	765 000	EUR	727 248	732 579	0,67
France OAT 0.50% 19 - 25.05.29	922 000	EUR	827 035	841 731	0,77
France OAT 0.75% 17 - 25.05.28	1 007 000	EUR	930 341	945 593	0,87
France OAT 0.75% 18 - 25.11.28	914 000	EUR	838 335	852 570	0,78
France OAT 0.75% 20 - 25.05.52	532 000	EUR	302 406	305 873	0,28
France OAT 0.75% 22 - 25.02.28	758 000	EUR	702 276	714 392	0,66
France OAT 1.00% 15 - 25.11.25	615 000	EUR	596 426	598 506	0,55
France OAT 1.00% 17 - 25.05.27	674 000	EUR	639 777	646 636	0,59
France OAT 1.25% 18 - 25.05.34	708 000	EUR	605 359	623 394	0,57
France OAT 1.25% 22 - 25.05.38	284 000	EUR	219 721	231 829	0,21
France OAT 1.50% 15 - 25.05.31	964 000	EUR	893 009	911 018	0,84
France OAT 2.00% 22 - 25.11.32	747 000	EUR	699 103	720 362	0,66
France OAT 2.50% 14 - 25.05.30	954 000	EUR	947 371	966 812	0,89
France OAT 2.50% 23 - 24.09.26	728 000	EUR	720 054	731 028	0,67
France OAT 2.75% 12 - 25.10.27	897 000	EUR	901 821	913 550	0,84
France OAT 2.75% 23 - 25.02.29	485 000	EUR	481 889	496 463	0,46
France OAT 3.00% 23 - 25.05.33	581 000	EUR	579 651	605 477	0,56
France OAT 3.25% 13 - 25.05.45	466 000	EUR	474 739	487 566	0,45
France OAT 3.50% 10 - 25.04.26	679 000	EUR	691 727	696 314	0,64
France OAT 3.50% 23 - 25.11.33	231 000	EUR	236 669	250 224	0,23
France OAT 4.00% 06 - 25.10.38	441 000	EUR	487 701	505 642	0,47
France OAT 4.00% 10 - 25.04.60	316 000	EUR	368 532	379 061	0,35
France OAT 4.50% 09 - 25.04.41	584 000	EUR	687 280	713 619	0,66

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 4.75% 04 - 25.04.35	423 000	EUR	494 042	510 176	0,47
France OAT 5.50% 98 - 25.04.29	588 000	EUR	671 013	681 480	0,63
France OAT 5.75% 01 - 25.10.32	545 000	EUR	669 312	685 643	0,63
France OAT 6.00% 94 - 25.10.25	451 000	EUR	476 888	478 439	0,44
France OAT 144A 0.50% 20 - 25.05.40	386 000	EUR	261 107	268 058	0,25
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.05.72	198 000	EUR	80 509	83 500	0,08
France OAT 144A 0.50% 21 - 25.06.44	381 000	EUR	229 247	239 508	0,22
France OAT 144A 0.75% 21 - 25.05.53	482 000	EUR	265 093	271 694	0,25
France OAT 144A 1.25% 16 - 25.05.36	714 000	EUR	585 149	605 508	0,56
France OAT 144A 1.50% 19 - 25.05.50	498 000	EUR	356 015	362 858	0,33
France OAT 144A 1.75% 16 - 25.05.66	272 000	EUR	197 538	195 348	0,18
France OAT 144A 1.75% 17 - 25.06.39	532 000	EUR	447 760	463 595	0,43
France OAT 144A 2.00% 17 - 25.05.48	465 000	EUR	376 475	385 885	0,36
France OAT 144A 2.50% 22 - 25.05.43	222 000	EUR	195 966	207 075	0,19
France OAT 144A 3.00% 23 - 25.05.54	323 000	EUR	290 617	316 989	0,29
France OAT 144A 4.00% 05 - 25.04.55	321 000	EUR	372 739	380 237	0,35
			26 808 040	27 357 964	25,18
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 16 - 15.08.26	668 000	EUR	628 822	632 369	0,58
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.29	581 000	EUR	514 338	523 394	0,48
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 15.08.50	804 000	EUR	438 331	448 994	0,41
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.02.30	594 000	EUR	519 341	530 204	0,49
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 11.04.25	494 000	EUR	477 843	477 174	0,44
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.05.35	515 000	EUR	392 685	406 273	0,38
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.11.27	452 000	EUR	414 730	419 275	0,39
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	643 000	EUR	557 148	568 573	0,52
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	526 000	EUR	502 733	504 539	0,47
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 15.08.30	177 000	EUR	154 408	156 233	0,14
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 20 - 10.10.25	140 000	EUR	133 385	134 582	0,12
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.02.31	600 000	EUR	513 625	524 976	0,48
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 10.04.26	582 000	EUR	551 467	553 785	0,51
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.05.36	499 000	EUR	374 388	383 237	0,35
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.11.28	585 000	EUR	526 215	533 900	0,49

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 21 - 15.08.50	187 000	EUR	105 632	104 646	0,10
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	610 000	EUR	517 354	528 364	0,49
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 09.10.26	470 000	EUR	440 321	443 487	0,41
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.52	637 000	EUR	328 024	340 050	0,31
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 21 - 15.08.31	168 000	EUR	142 328	145 452	0,13
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.02.32	630 000	EUR	526 971	539 400	0,50
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 16.04.27	385 000	EUR	357 197	360 610	0,33
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.10.27	641 000	EUR	617 052	625 667	0,58
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 17 - 15.02.27	656 000	EUR	614 955	621 179	0,57
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 18 - 15.08.28	533 000	EUR	486 580	494 731	0,46
Bundesrepublik Deutschland 0.25% 19 - 15.02.29	598 000	EUR	542 157	551 135	0,51
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 15 - 15.02.25	576 000	EUR	561 646	561 145	0,52
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 16 - 15.02.26	679 000	EUR	651 836	654 115	0,60
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 17 - 15.08.27	688 000	EUR	646 419	653 043	0,60
Bundesrepublik Deutschland 0.50% 18 - 15.02.28	618 000	EUR	576 489	583 522	0,54
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 15 - 15.08.25	583 000	EUR	568 618	568 868	0,52
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 22 - 15.05.38	454 000	EUR	371 058	386 517	0,36
Bundesrepublik Deutschland 1.25% 17 - 15.08.48	766 000	EUR	610 281	622 980	0,57
Bundesrepublik Deutschland 1.30% 22 - 15.10.27	112 000	EUR	108 079	109 633	0,10
Bundesrepublik Deutschland 1.70% 22 - 15.08.32	569 000	EUR	545 148	557 512	0,51
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 22 - 15.08.53	524 000	EUR	441 293	473 607	0,44
Bundesrepublik Deutschland 1.80% 23 - 15.08.53	114 000	EUR	97 326	103 251	0,10
Bundesrepublik Deutschland 2.10% 22 - 15.11.29	547 000	EUR	539 013	552 475	0,51
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 23 - 13.04.28	505 000	EUR	500 044	509 667	0,47
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	774 000	EUR	766 767	794 209	0,73
Bundesrepublik Deutschland 2.30% 23 - 15.02.33	131 000	EUR	129 737	134 524	0,12
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 19.10.28	608 000	EUR	603 583	620 604	0,57
Bundesrepublik Deutschland 2.40% 23 - 15.11.30	262 000	EUR	260 089	269 876	0,25
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 12 - 04.07.44	628 000	EUR	639 172	649 917	0,60
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 14 - 15.08.46	644 000	EUR	659 330	669 766	0,62
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 23 - 13.03.25	385 000	EUR	382 890	383 522	0,35
Bundesrepublik Deutschland 2.60% 23 - 15.08.33	643 000	EUR	647 576	675 896	0,62
Bundesrepublik Deutschland 2.80% 23 - 12.06.25	381 000	EUR	380 209	381 650	0,35
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 18.09.25	388 000	EUR	388 608	391 799	0,36
Bundesrepublik Deutschland 3.10% 23 - 12.12.25	307 000	EUR	309 162	310 982	0,29
Bundesrepublik Deutschland 3.25% 10 - 04.07.42	393 000	EUR	439 540	449 478	0,41
Bundesrepublik Deutschland 4.00% 05 - 04.01.37	551 000	EUR	646 630	663 690	0,61
Bundesrepublik Deutschland 4.25% 07 - 04.07.39	373 000	EUR	458 656	469 894	0,43
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 98 - 04.07.28	285 000	EUR	316 327	319 254	0,29
Bundesrepublik Deutschland 4.75% 03 - 04.07.34	522 000	EUR	637 579	653 737	0,60

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 - 04.07.40	457 000	EUR	596 347	612 353	0,56
Bundesrepublik Deutschland 5.50% 00 - 04.01.31	453 000	EUR	546 242	558 413	0,52
Bundesrepublik Deutschland 5.625% 98 - 04.01.28	356 000	EUR	400 018	405 687	0,37
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 00 - 04.01.30	271 000	EUR	331 648	336 972	0,31
Bundesrepublik Deutschland 6.50% 97 - 04.07.27	290 000	EUR	330 190	333 358	0,31
			27 465 580	27 974 145	25,75
Irlande					
Ireland Zero Coupon 21 - 18.10.31	179 000	EUR	146 198	150 358	0,14
Ireland 0.20% 20 - 15.05.27	157 000	EUR	145 017	147 100	0,13
Ireland 0.20% 20 - 18.10.30	165 000	EUR	139 899	143 792	0,13
Ireland 0.35% 22 - 18.10.32	100 000	EUR	81 558	83 985	0,08
Ireland 0.40% 20 - 15.05.35	127 000	EUR	96 241	101 128	0,09
Ireland 0.55% 21 - 22.04.41	80 000	EUR	52 745	55 962	0,05
Ireland 0.90% 18 - 15.05.28	174 000	EUR	161 603	165 180	0,15
Ireland 1.00% 16 - 15.05.26	221 000	EUR	212 994	214 518	0,20
Ireland 1.10% 19 - 15.05.29	202 000	EUR	187 244	191 066	0,18
Ireland 1.30% 18 - 15.05.33	108 000	EUR	95 089	98 413	0,09
Ireland 1.35% 18 - 18.03.31	100 000	EUR	91 641	93 850	0,09
Ireland 1.50% 19 - 15.05.50	171 000	EUR	122 857	129 623	0,12
Ireland 1.70% 17 - 15.05.37	153 000	EUR	131 351	136 982	0,13
Ireland 2.00% 15 - 18.02.45	215 000	EUR	178 018	185 255	0,17
Ireland 2.40% 14 - 15.05.30	172 000	EUR	170 025	173 914	0,16
Ireland 3.00% 23 - 18.10.43	69 000	EUR	66 522	71 221	0,06
Ireland 5.40% 09 - 13.03.25	218 000	EUR	224 883	224 189	0,21
			2 303 885	2 366 536	2,18
Italie					
Italy Zero Coupon 21 - 01.04.26	235 000	EUR	218 006	220 629	0,20
Italy Zero Coupon 21 - 01.08.26	196 000	EUR	180 059	182 506	0,17
Italy 0.25% 21 - 15.03.28	191 000	EUR	166 719	171 065	0,16
Italy 0.35% 19 - 01.02.25	213 000	EUR	206 515	206 477	0,19
Italy 0.45% 21 - 15.02.29	168 000	EUR	142 617	147 555	0,14
Italy 0.50% 20 - 01.02.26	212 000	EUR	200 224	201 947	0,19
Italy 0.50% 21 - 15.07.28	172 000	EUR	150 365	154 337	0,14
Italy 0.85% 19 - 15.01.27	196 000	EUR	182 170	185 017	0,17
Italy 0.90% 20 - 01.04.31	265 000	EUR	216 530	224 001	0,21
Italy 0.95% 20 - 01.08.30	181 000	EUR	151 810	156 441	0,14
Italy 0.95% 20 - 15.09.27	230 000	EUR	211 061	214 857	0,20
Italy 0.95% 21 - 01.06.32	220 000	EUR	173 488	180 065	0,17
Italy 1.10% 22 - 01.04.27	181 000	EUR	168 258	171 420	0,16
Italy 1.20% 22 - 15.08.25	156 000	EUR	151 270	151 615	0,14
Italy 1.25% 16 - 01.12.26	215 000	EUR	203 208	205 909	0,19
Italy 1.35% 19 - 01.04.30	240 000	EUR	208 940	215 083	0,20
Italy 1.45% 18 - 15.05.25	120 000	EUR	117 486	117 448	0,11
Italy 1.50% 15 - 01.06.25	185 000	EUR	180 477	181 021	0,17
Italy 1.60% 16 - 01.06.26	253 000	EUR	242 825	246 019	0,23
Italy 2.00% 15 - 01.12.25	216 000	EUR	211 374	212 515	0,19
Italy 2.00% 18 - 01.02.28	252 000	EUR	238 500	243 547	0,22
Italy 2.05% 17 - 01.08.27	203 000	EUR	194 096	197 667	0,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.10% 19 - 15.07.26	188 000	EUR	182 268	184 850	0,17
Italy 2.20% 17 - 01.06.27	188 000	EUR	181 272	184 257	0,17
Italy 2.50% 18 - 15.11.25	204 000	EUR	201 572	202 608	0,19
Italy 2.50% 22 - 01.12.32	180 000	EUR	159 626	166 119	0,15
Italy 2.65% 22 - 01.12.27	186 000	EUR	179 351	184 487	0,17
Italy 2.80% 18 - 01.12.28	236 000	EUR	228 490	233 902	0,21
Italy 2.80% 22 - 15.06.29	167 000	EUR	159 793	164 533	0,15
Italy 3.00% 19 - 01.08.29	234 000	EUR	226 211	233 025	0,21
Italy 3.40% 22 - 01.04.28	227 000	EUR	225 987	231 177	0,21
Italy 3.40% 23 - 28.03.25	181 000	EUR	180 801	181 424	0,17
Italy 3.50% 22 - 15.01.26	169 000	EUR	168 938	171 143	0,16
Italy 3.60% 23 - 29.09.25	145 000	EUR	144 611	146 476	0,13
Italy 3.70% 23 - 15.06.30	139 000	EUR	137 138	142 399	0,13
Italy 3.80% 23 - 15.04.26	150 000	EUR	151 394	153 155	0,14
Italy 3.80% 23 - 01.08.28	182 000	EUR	180 990	188 135	0,17
Italy 3.85% 22 - 15.12.29	190 000	EUR	190 101	196 622	0,18
Italy 3.85% 23 - 15.09.26	239 000	EUR	242 212	245 293	0,23
Italy 4.00% 23 - 15.11.30	146 000	EUR	149 859	151 963	0,14
Italy 4.10% 23 - 01.02.29	141 000	EUR	145 121	147 685	0,14
Italy 4.20% 23 - 01.03.34	130 000	EUR	127 010	135 320	0,12
Italy 4.35% 23 - 01.11.33	208 000	EUR	209 916	219 654	0,20
Italy 4.40% 22 - 01.05.33	226 000	EUR	230 343	240 753	0,22
Italy 5.25% 98 - 01.11.29	324 000	EUR	351 581	360 434	0,33
Italy 5.75% 02 - 01.02.33	278 000	EUR	311 772	324 430	0,30
Italy 6.00% 00 - 01.05.31	346 000	EUR	393 985	406 688	0,37
Italy 6.50% 97 - 01.11.27	270 000	EUR	300 090	305 234	0,28
Italy 7.25% 97 - 01.11.26	103 000	EUR	114 160	115 351	0,11
Italy 144A 0.60% 21 - 01.08.31	258 000	EUR	203 914	210 750	0,19
Italy 144A 0.95% 21 - 01.03.37	129 000	EUR	88 334	90 365	0,08
Italy 144A 0.95% 21 - 01.12.31	174 000	EUR	139 072	144 664	0,13
Italy 144A 1.45% 20 - 01.03.36	139 000	EUR	102 902	106 910	0,10
Italy 144A 1.50% 21 - 30.04.45	140 000	EUR	87 567	88 452	0,08
Italy 144A 1.65% 15 - 01.03.32	276 000	EUR	233 114	240 738	0,22
Italy 144A 1.65% 20 - 01.12.30	229 000	EUR	198 480	205 742	0,19
Italy 144A 1.70% 20 - 01.09.51	160 000	EUR	97 746	98 089	0,09
Italy 144A 1.80% 20 - 01.03.41	175 000	EUR	123 508	126 126	0,12
Italy 144A 1.85% 20 - 01.07.25	187 000	EUR	183 613	183 765	0,17
Italy 144A 2.15% 21 - 01.03.72	66 000	EUR	39 398	40 089	0,04
Italy 144A 2.15% 22 - 01.09.52	94 000	EUR	60 275	62 523	0,06
Italy 144A 2.25% 16 - 01.09.36	215 000	EUR	175 087	179 933	0,17
Italy 144A 2.45% 17 - 01.09.33	199 000	EUR	173 387	180 786	0,17
Italy 144A 2.45% 20 - 01.09.50	208 000	EUR	145 435	152 000	0,14
Italy 144A 2.70% 16 - 01.03.47	208 000	EUR	158 430	164 122	0,15
Italy 144A 2.80% 16 - 01.03.67	108 000	EUR	76 377	78 972	0,07
Italy 144A 2.95% 18 - 01.09.38	173 000	EUR	149 044	153 357	0,14
Italy 144A 3.10% 19 - 01.03.40	150 000	EUR	126 607	132 781	0,12
Italy 144A 3.25% 15 - 01.09.46	165 000	EUR	140 349	142 898	0,13
Italy 144A 3.25% 22 - 01.03.38	119 000	EUR	104 350	109 211	0,10

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 3.35% 19 - 01.03.35	186 000	EUR	169 896	178 835	0,16
Italy 144A 3.45% 17 - 01.03.48	186 000	EUR	164 235	164 737	0,15
Italy 144A 3.50% 14 - 01.03.30	348 000	EUR	344 314	354 709	0,33
Italy 144A 3.85% 19 - 01.09.49	168 000	EUR	154 919	158 626	0,15
Italy 144A 4.00% 05 - 01.02.37	377 000	EUR	371 955	381 461	0,35
Italy 144A 4.00% 22 - 30.04.35	120 000	EUR	115 733	122 174	0,11
Italy 144A 4.00% 23 - 30.10.31	102 000	EUR	102 344	106 251	0,10
Italy 144A 4.45% 23 - 01.09.43	108 000	EUR	105 738	111 323	0,10
Italy 144A 4.50% 10 - 01.03.26	239 000	EUR	244 952	247 193	0,23
Italy 144A 4.50% 23 - 01.10.53	71 000	EUR	68 937	72 959	0,07
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.28	279 000	EUR	295 403	300 320	0,28
Italy 144A 4.75% 13 - 01.09.44	210 000	EUR	219 964	226 116	0,21
Italy 144A 5.00% 03 - 01.08.34	298 000	EUR	318 114	331 576	0,30
Italy 144A 5.00% 07 - 01.08.39	280 000	EUR	301 051	309 179	0,28
Italy 144A 5.00% 09 - 01.03.25	283 000	EUR	288 546	288 658	0,27
Italy 144A 5.00% 09 - 01.09.40	247 000	EUR	265 331	272 848	0,25
			15 929 011	16 323 496	15,02
Lettonie					
Latvia 0.375% 16 - 07.10.26	100 000	EUR	91 821	93 017	0,09
			91 821	93 017	0,09
Lituanie					
Lithuania 0.50% 20 - 28.07.50	24 000	EUR	11 038	11 927	0,01
Lithuania 0.75% 20 - 06.05.30	10 000	EUR	8 356	8 562	0,01
Lithuania 0.95% 17 - 26.05.27	10 000	EUR	9 209	9 273	0,01
Lithuania 2.125% 15 - 22.10.35	9 000	EUR	7 614	7 883	0,01
Lithuania 2.125% 22 - 01.06.32	13 000	EUR	11 553	11 900	0,01
Lithuania 3.875% 23 - 14.06.33	15 000	EUR	15 126	15 700	0,01
			62 896	65 245	0,06
Luxembourg					
Luxembourg Zero Coupon 19 - 13.11.26	42 000	EUR	38 949	39 254	0,04
Luxembourg Zero Coupon 20 - 28.04.25	37 000	EUR	35 640	35 585	0,03
Luxembourg Zero Coupon 20 - 28.04.30	22 000	EUR	18 717	18 979	0,02
Luxembourg Zero Coupon 20 - 14.09.32	34 000	EUR	26 827	27 602	0,03
Luxembourg Zero Coupon 21 - 24.03.31	62 000	EUR	51 034	52 223	0,05
Luxembourg 0.625% 17 - 01.02.27	51 000	EUR	47 681	48 270	0,04
Luxembourg 1.375% 22 - 25.05.29	31 000	EUR	29 152	29 519	0,03
Luxembourg 1.75% 22 - 25.05.42	28 000	EUR	24 171	23 713	0,02
Luxembourg 3.00% 23 - 02.03.33	35 000	EUR	34 988	36 604	0,03
Luxembourg 3.25% 23 - 02.03.43	53 000	EUR	54 042	56 078	0,05
			361 201	367 827	0,34
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.07.30	285 000	EUR	241 825	247 976	0,23
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.27	319 000	EUR	295 845	298 667	0,27
Netherlands 144A Zero Coupon 20 - 15.01.52	357 000	EUR	178 839	184 141	0,17
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.07.31	312 000	EUR	259 526	264 985	0,24
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.38	212 000	EUR	145 417	150 138	0,14
Netherlands 144A Zero Coupon 21 - 15.01.29	230 000	EUR	203 191	206 732	0,19
Netherlands 144A Zero Coupon 22 - 15.01.26	308 000	EUR	291 792	292 769	0,27

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 0.25% 15 - 15.07.25	397 000	EUR	382 744	383 371	0,35
Netherlands 144A 0.25% 19 - 15.07.29	245 000	EUR	217 739	221 262	0,20
Netherlands 144A 0.50% 16 - 15.07.26	370 000	EUR	351 647	354 264	0,33
Netherlands 144A 0.50% 19 - 15.01.40	305 000	EUR	220 107	226 142	0,21
Netherlands 144A 0.50% 22 - 15.07.32	265 000	EUR	224 100	228 825	0,21
Netherlands 144A 0.75% 17 - 15.07.27	313 000	EUR	294 323	298 424	0,27
Netherlands 144A 0.75% 18 - 15.07.28	376 000	EUR	349 069	353 918	0,32
Netherlands 144A 2.00% 22 - 15.01.54	165 000	EUR	145 787	148 952	0,14
Netherlands 144A 2.50% 12 - 15.01.33	258 000	EUR	255 427	262 742	0,24
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.07.33	244 000	EUR	235 635	247 811	0,23
Netherlands 144A 2.50% 23 - 15.01.30	139 000	EUR	137 731	141 648	0,13
Netherlands 144A 2.75% 14 - 15.01.47	423 000	EUR	433 116	443 452	0,41
Netherlands 144A 3.25% 23 - 15.01.44	85 000	EUR	85 455	94 660	0,09
Netherlands 144A 3.75% 10 - 15.01.42	366 000	EUR	419 279	431 865	0,40
Netherlands 144A 4.00% 05 - 15.01.37	332 000	EUR	379 375	387 766	0,36
Netherlands 144A 5.50% 98 - 15.01.28	253 000	EUR	280 755	285 171	0,26
			6 028 724	6 155 681	5,66
Portugal					
Portugal 144A 0.30% 21 - 17.10.31	97 000	EUR	78 824	81 959	0,07
Portugal 144A 0.475% 20 - 18.10.30	123 000	EUR	104 119	108 256	0,10
Portugal 144A 0.70% 20 - 15.10.27	76 000	EUR	70 890	71 891	0,07
Portugal 144A 0.90% 20 - 12.10.35	85 000	EUR	64 875	68 326	0,06
Portugal 144A 1.00% 21 - 12.04.52	68 000	EUR	36 640	39 542	0,04
Portugal 144A 1.15% 22 - 11.04.42	42 000	EUR	29 015	30 223	0,03
Portugal 144A 1.65% 22 - 16.07.32	73 000	EUR	64 989	67 685	0,06
Portugal 144A 1.95% 19 - 15.06.29	147 000	EUR	140 707	144 552	0,13
Portugal 144A 2.125% 18 - 17.10.28	179 000	EUR	174 480	178 200	0,16
Portugal 144A 2.25% 18 - 18.04.34	87 000	EUR	79 699	83 161	0,08
Portugal 144A 2.875% 15 - 15.10.25	164 000	EUR	164 748	165 286	0,15
Portugal 144A 2.875% 16 - 21.07.26	114 000	EUR	114 687	116 060	0,11
Portugal 144A 3.50% 23 - 18.06.38	41 000	EUR	41 078	42 827	0,04
Portugal 144A 3.875% 14 - 15.02.30	76 000	EUR	80 167	82 490	0,08
Portugal 144A 4.10% 06 - 15.04.37	112 000	EUR	119 696	125 234	0,11
Portugal 144A 4.10% 15 - 15.02.45	50 000	EUR	53 232	56 776	0,05
Portugal 144A 4.125% 17 - 14.04.27	109 000	EUR	113 607	115 385	0,11
			1 531 453	1 577 853	1,45
Slovaquie					
Slovakia 0.125% 20 - 17.06.27	20 000	EUR	17 987	18 238	0,02
Slovakia 0.25% 20 - 14.05.25	35 000	EUR	33 681	33 621	0,03
Slovakia 0.375% 21 - 21.04.36	32 000	EUR	21 629	22 031	0,02
Slovakia 0.625% 16 - 22.05.26	10 000	EUR	9 472	9 493	0,01
Slovakia 0.75% 19 - 09.04.30	31 000	EUR	26 799	27 154	0,02
Slovakia 1.00% 18 - 12.06.28	21 000	EUR	19 150	19 375	0,02
Slovakia 1.00% 20 - 09.10.30	26 000	EUR	22 011	22 835	0,02
Slovakia 1.00% 20 - 14.05.32	24 000	EUR	20 314	20 284	0,02
Slovakia 1.00% 21 - 13.10.51	13 000	EUR	7 103	6 722	0,01
Slovakia 1.375% 15 - 21.01.27	24 000	EUR	22 909	22 982	0,02
Slovakia 1.625% 16 - 21.01.31	26 000	EUR	23 404	23 742	0,02

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Slovaquie (suite)					
Slovakia 1.875% 17 - 09.03.37	21 000	EUR	16 703	17 308	0,02
Slovakia 2.00% 17 - 17.10.47	40 000	EUR	28 932	29 500	0,03
Slovakia 3.625% 14 - 16.01.29	6 000	EUR	6 159	6 200	0,00
Slovakia 3.75% 23 - 23.02.35	29 000	EUR	28 383	29 812	0,03
Slovakia 3.875% 13 - 08.02.33	33 000	EUR	33 469	34 928	0,03
Slovakia 4.00% 22 - 19.10.32	25 000	EUR	25 810	26 623	0,02
Slovakia 4.00% 23 - 23.02.43	3 000	EUR	2 925	3 112	0,00
Slovakia 4.35% 10 - 14.10.25	21 000	EUR	21 426	21 436	0,02
			388 266	395 396	0,36
Slovénie					
Slovenia Zero Coupon 21 - 12.02.31	29 000	EUR	22 971	23 802	0,02
Slovenia Zero Coupon 22 - 13.02.26	10 000	EUR	9 511	9 401	0,01
Slovenia 0.125% 21 - 01.07.31	14 000	EUR	11 134	11 491	0,01
Slovenia 0.275% 20 - 14.01.30	20 000	EUR	16 940	17 236	0,02
Slovenia 0.488% 20 - 20.10.50	25 000	EUR	11 778	12 888	0,01
Slovenia 0.875% 20 - 15.07.30	11 000	EUR	9 526	9 760	0,01
Slovenia 1.00% 18 - 06.03.28	22 000	EUR	20 408	20 585	0,02
Slovenia 1.188% 19 - 14.03.29	39 000	EUR	35 687	36 078	0,03
Slovenia 1.25% 17 - 22.03.27	39 000	EUR	36 688	37 225	0,04
Slovenia 1.50% 15 - 25.03.35	30 000	EUR	24 643	25 342	0,02
Slovenia 1.75% 16 - 03.11.40	31 000	EUR	23 215	25 086	0,02
Slovenia 2.125% 15 - 28.07.25	19 000	EUR	19 002	18 764	0,02
Slovenia 2.25% 16 - 03.03.32	45 000	EUR	41 554	43 104	0,04
Slovenia 3.125% 15 - 07.08.45	22 000	EUR	20 663	21 793	0,02
Slovenia 3.625% 23 - 11.03.33	14 000	EUR	13 829	14 785	0,01
Slovenia 5.125% 11 - 30.03.26	20 000	EUR	21 177	20 937	0,02
			338 726	348 277	0,32
Espagne					
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.25	222 000	EUR	215 298	214 845	0,20
Spain Zero Coupon 20 - 31.01.26	235 000	EUR	221 272	222 410	0,20
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.28	312 000	EUR	277 063	282 023	0,26
Spain Zero Coupon 21 - 31.01.27	241 000	EUR	221 078	223 012	0,21
Spain Zero Coupon 22 - 31.05.25	243 000	EUR	233 018	233 282	0,21
Spain 0.80% 22 - 30.07.29	301 000	EUR	266 382	272 888	0,25
Spain 2.80% 23 - 31.05.26	259 000	EUR	256 547	260 137	0,24
Spain 5.75% 01 - 30.07.32	267 000	EUR	319 005	326 450	0,30
Spain 6.00% 98 - 31.01.29	306 000	EUR	350 609	355 936	0,33
Spain 144A 0.10% 21 - 30.04.31	283 000	EUR	228 777	233 823	0,22
Spain 144A 0.50% 20 - 30.04.30	290 000	EUR	248 726	254 321	0,23
Spain 144A 0.50% 21 - 31.10.31	241 000	EUR	197 167	202 653	0,19
Spain 144A 0.60% 19 - 31.10.29	245 000	EUR	213 697	218 822	0,20
Spain 144A 0.70% 22 - 30.04.32	264 000	EUR	217 143	222 707	0,20
Spain 144A 0.80% 20 - 30.07.27	244 000	EUR	227 392	229 855	0,21
Spain 144A 0.85% 21 - 30.07.37	162 000	EUR	115 400	119 725	0,11
Spain 144A 1.00% 20 - 31.10.50	232 000	EUR	127 562	130 704	0,12
Spain 144A 1.00% 21 - 30.07.42	124 000	EUR	78 340	83 260	0,08
Spain 144A 1.20% 20 - 31.10.40	259 000	EUR	179 766	186 524	0,17
Spain 144A 1.25% 20 - 31.10.30	272 000	EUR	242 199	247 393	0,23

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A 1.30% 16 - 31.10.26	320 000	EUR	305 978	309 363	0,28
Spain 144A 1.40% 18 - 30.04.28	322 000	EUR	302 502	307 439	0,28
Spain 144A 1.40% 18 - 30.07.28	273 000	EUR	255 881	259 978	0,24
Spain 144A 1.45% 17 - 31.10.27	239 000	EUR	226 523	229 892	0,21
Spain 144A 1.45% 19 - 30.04.29	248 000	EUR	229 155	234 474	0,22
Spain 144A 1.45% 21 - 31.10.71	105 000	EUR	50 217	53 270	0,05
Spain 144A 1.50% 17 - 30.04.27	336 000	EUR	321 334	325 171	0,30
Spain 144A 1.60% 15 - 30.04.25	248 000	EUR	243 733	243 700	0,22
Spain 144A 1.85% 19 - 30.07.35	217 000	EUR	184 478	191 290	0,18
Spain 144A 1.90% 22 - 31.10.52	214 000	EUR	139 762	148 599	0,14
Spain 144A 1.95% 15 - 30.07.30	254 000	EUR	238 413	243 266	0,22
Spain 144A 1.95% 16 - 30.04.26	246 000	EUR	241 242	242 308	0,22
Spain 144A 2.15% 15 - 31.10.25	296 000	EUR	292 821	293 271	0,27
Spain 144A 2.35% 17 - 30.07.33	228 000	EUR	209 948	217 332	0,20
Spain 144A 2.55% 22 - 31.10.32	264 000	EUR	249 011	257 325	0,24
Spain 144A 2.70% 18 - 31.10.48	200 000	EUR	168 688	172 712	0,16
Spain 144A 2.90% 16 - 31.10.46	220 000	EUR	194 551	199 672	0,18
Spain 144A 3.15% 23 - 30.04.33	291 000	EUR	282 881	295 797	0,27
Spain 144A 3.45% 16 - 30.07.66	161 000	EUR	149 716	149 955	0,14
Spain 144A 3.45% 22 - 30.07.43	80 000	EUR	76 379	79 264	0,07
Spain 144A 3.50% 23 - 31.05.29	65 000	EUR	65 970	67 869	0,06
Spain 144A 3.55% 23 - 31.10.33	250 000	EUR	249 780	261 769	0,24
Spain 144A 3.90% 23 - 30.07.39	88 000	EUR	88 328	93 238	0,09
Spain 144A 4.20% 05 - 31.01.37	263 000	EUR	282 288	291 709	0,27
Spain 144A 4.65% 10 - 30.07.25	252 000	EUR	258 986	258 791	0,24
Spain 144A 4.70% 09 - 30.07.41	241 000	EUR	272 760	282 792	0,26
Spain 144A 4.90% 07 - 30.07.40	248 000	EUR	286 881	294 793	0,27
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.28	211 000	EUR	230 469	235 940	0,22
Spain 144A 5.15% 13 - 31.10.44	196 000	EUR	236 999	244 671	0,23
Spain 144A 5.90% 11 - 30.07.26	271 000	EUR	291 624	292 921	0,27
			11 063 739	11 299 341	10,40
Total - Obligations			105 366 196	107 617 565	99,05

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	7	EUR	70 172	70 347	0,06
			70 172	70 347	0,06
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			70 172	70 347	0,06
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			105 436 368	107 687 912	99,11
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			105 436 368	107 687 912	99,11
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				108 713 891	100,06

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Brésil					
Brazil Zero Coupon 22 - 01.07.25	2 130 000	BRL	367 334	381 565	1,10
Brazil Zero Coupon 22 - 01.01.26	3 100 000	BRL	519 999	530 048	1,52
Brazil Zero Coupon 23 - 01.07.26	2 800 000	BRL	445 343	457 032	1,31
Brazil Zero Coupon 23 - 01.07.27	1 000 000	BRL	148 615	147 979	0,43
Brazil 10.00% 14 - 01.01.25	1 670 000	BRL	339 145	343 593	0,99
Brazil 10.00% 16 - 01.01.27	2 073 000	BRL	407 055	428 578	1,23
Brazil 10.00% 18 - 01.01.29	3 010 000	BRL	593 874	618 266	1,78
Brazil 10.00% 20 - 01.01.31	1 150 000	BRL	214 144	234 216	0,67
Brazil 10.00% 22 - 01.01.33	987 000	BRL	178 794	199 701	0,57
			3 214 303	3 340 978	9,60
Chili					
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 2.50% 20 - 01.03.25	120 000 000	CLP	140 520	131 790	0,38
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.50% 15 - 01.03.26	55 000 000	CLP	66 431	61 853	0,18
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.00% 15 - 01.03.35	90 000 000	CLP	109 106	101 285	0,29
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 6.00% 13 - 01.01.43	75 000 000	CLP	101 903	93 413	0,27
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 2.30% 20 - 01.10.28	30 000 000	CLP	31 360	30 031	0,09
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 4.70% 18 - 01.09.30	80 000 000	CLP	95 692	88 288	0,25
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 5.00% 21 - 01.10.28	30 000 000	CLP	36 333	33 873	0,10
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 6.00% 23 - 01.04.33	65 000 000	CLP	82 321	77 901	0,22
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A 7.00% 22 - 01.05.34	20 000 000	CLP	26 653	25 803	0,07
			690 319	644 237	1,85
Chine					
China 1.99% 20 - 09.04.25	530 000	CNY	76 005	74 536	0,21
China 2.18% 22 - 25.08.25	380 000	CNY	54 756	53 563	0,15
China 2.18% 23 - 15.08.26	370 000	CNY	50 588	52 033	0,15
China 2.24% 22 - 25.05.25	320 000	CNY	46 072	45 158	0,13
China 2.26% 22 - 24.02.25	300 000	CNY	43 443	42 345	0,12
China 2.28% 22 - 25.11.25	340 000	CNY	48 934	48 001	0,14
China 2.30% 23 - 15.05.26	420 000	CNY	57 927	59 271	0,17
China 2.37% 22 - 20.01.27	340 000	CNY	48 753	47 994	0,14
China 2.40% 23 - 15.07.28	200 000	CNY	27 201	28 227	0,08
China 2.44% 22 - 15.10.27	310 000	CNY	44 568	43 857	0,13
China 2.46% 23 - 15.02.26	430 000	CNY	62 113	60 902	0,17
China 2.47% 21 - 02.09.24	360 000	CNY	51 961	50 884	0,15
China 2.48% 22 - 15.04.27	290 000	CNY	41 762	41 031	0,12
China 2.48% 23 - 25.09.28	250 000	CNY	34 916	35 395	0,10
China 2.50% 22 - 25.07.27	410 000	CNY	59 116	58 070	0,17
China 2.52% 23 - 25.08.33	600 000	CNY	81 331	84 209	0,24
China 2.55% 23 - 15.10.28	400 000	CNY	55 821	56 813	0,16

Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Chine (suite)					
China 2.60% 22 - 01.09.32	380 000	CNY	53 595	53 600	0,15
China 2.60% 23 - 15.09.30	530 000	CNY	73 196	75 051	0,22
China 2.62% 22 - 25.09.29	350 000	CNY	50 268	49 708	0,14
China 2.62% 23 - 15.04.28	410 000	CNY	57 408	58 389	0,17
China 2.62% 23 - 25.06.30	350 000	CNY	48 911	49 611	0,14
China 2.64% 23 - 15.01.28	390 000	CNY	56 533	55 528	0,16
China 2.67% 23 - 25.05.33	410 000	CNY	56 581	58 099	0,17
China 2.67% 23 - 25.11.33	500 000	CNY	70 660	71 189	0,20
China 2.68% 20 - 21.05.30	710 000	CNY	101 707	100 948	0,29
China 2.69% 21 - 12.08.26	780 000	CNY	112 713	111 102	0,32
China 2.69% 22 - 15.08.32	380 000	CNY	54 496	53 980	0,16
China 2.75% 22 - 17.02.32	350 000	CNY	50 375	49 947	0,14
China 2.75% 22 - 15.06.29	360 000	CNY	52 319	51 478	0,15
China 2.76% 22 - 15.05.32	320 000	CNY	46 288	45 681	0,13
China 2.79% 22 - 15.12.29	380 000	CNY	55 076	54 421	0,16
China 2.80% 22 - 24.03.29	340 000	CNY	49 274	48 754	0,14
China 2.80% 22 - 15.11.32	340 000	CNY	49 013	48 751	0,14
China 2.80% 23 - 25.03.30	410 000	CNY	58 969	58 633	0,17
China 2.85% 20 - 04.06.27	680 000	CNY	98 193	97 431	0,28
China 2.88% 23 - 25.02.33	380 000	CNY	55 561	54 926	0,16
China 2.89% 21 - 18.11.31	300 000	CNY	43 656	43 284	0,12
China 2.91% 21 - 14.10.28	460 000	CNY	67 259	66 353	0,19
China 2.94% 19 - 17.10.24	360 000	CNY	52 202	51 105	0,15
China 3.00% 23 - 15.10.53	100 000	CNY	13 995	14 623	0,04
China 3.01% 21 - 13.05.28	890 000	CNY	130 566	128 757	0,37
China 3.02% 20 - 22.10.25	540 000	CNY	79 046	77 293	0,22
China 3.02% 21 - 27.05.31	520 000	CNY	76 376	75 642	0,22
China 3.03% 21 - 11.03.26	450 000	CNY	65 540	64 599	0,19
China 3.12% 19 - 05.12.26	400 000	CNY	58 768	57 809	0,17
China 3.12% 22 - 25.10.52	250 000	CNY	35 870	36 810	0,11
China 3.13% 19 - 21.11.29	390 000	CNY	57 327	56 992	0,16
China 3.19% 23 - 15.04.53	230 000	CNY	33 109	34 527	0,10
China 3.22% 18 - 06.12.25	340 000	CNY	49 604	48 920	0,14
China 3.25% 18 - 22.11.28	290 000	CNY	43 252	42 549	0,12
China 3.25% 19 - 06.06.26	450 000	CNY	66 396	65 038	0,19
China 3.27% 20 - 19.11.30	550 000	CNY	82 425	81 433	0,23
China 3.28% 20 - 03.12.27	490 000	CNY	72 614	71 713	0,21
China 3.29% 19 - 23.05.29	600 000	CNY	88 832	88 395	0,25
China 3.32% 22 - 15.04.52	240 000	CNY	35 867	36 638	0,11
China 3.53% 21 - 18.10.51	220 000	CNY	33 579	34 652	0,10
China 3.72% 21 - 12.04.51	260 000	CNY	41 220	42 249	0,12
China 3.81% 20 - 14.09.50	450 000	CNY	72 414	74 197	0,21
			3 436 320	3 423 094	9,84
Colombie					
Colombia 5.75% 20 - 03.11.27	412 400 000	COP	77 800	94 336	0,27
Colombia 6.00% 12 - 28.04.28	770 200 000	COP	146 799	175 638	0,51
Colombia 6.25% 17 - 26.11.25	338 700 000	COP	70 154	82 955	0,24
Colombia 6.25% 21 - 09.07.36	300 600 000	COP	46 259	56 769	0,16

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Colombie (suite)					
Colombia 7.00% 16 - 30.06.32	597 100 000	COP	103 654	129 235	0,37
Colombia 7.00% 21 - 26.03.31	655 500 000	COP	118 807	146 251	0,42
Colombia 7.25% 18 - 18.10.34	604 000 000	COP	102 077	128 435	0,37
Colombia 7.25% 20 - 26.10.50	562 400 000	COP	82 139	105 812	0,30
Colombia 7.50% 11 - 26.08.26	647 000 000	COP	133 262	159 913	0,46
Colombia 7.75% 14 - 18.09.30	457 600 000	COP	86 022	107 724	0,31
Colombia 9.25% 22 - 28.05.42	708 800 000	COP	135 052	166 760	0,48
Colombia 9.85% 07 - 28.06.27	50 000 000	COP	10 704	12 439	0,04
Colombia 13.25% 23 - 09.02.33	486 400 000	COP	123 650	149 559	0,43
			1 236 379	1 515 826	4,36
République tchèque					
Czech Republic Zero Coupon 21 - 12.12.24	830 000	CZK	36 618	35 485	0,10
Czech Republic 0.05% 20 - 29.11.29	1 690 000	CZK	61 262	61 174	0,18
Czech Republic 0.25% 17 - 10.02.27	3 190 000	CZK	128 989	127 541	0,37
Czech Republic 0.95% 15 - 15.05.30	3 430 000	CZK	127 482	129 887	0,37
Czech Republic 1.00% 15 - 26.06.26	3 150 000	CZK	131 719	130 868	0,38
Czech Republic 1.20% 20 - 13.03.31	3 350 000	CZK	125 608	126 361	0,36
Czech Republic 1.25% 20 - 14.02.25	2 430 000	CZK	107 740	104 711	0,30
Czech Republic 1.50% 20 - 24.04.40	1 340 000	CZK	41 230	43 198	0,12
Czech Republic 1.75% 21 - 23.06.32	3 050 000	CZK	116 218	117 651	0,34
Czech Republic 1.95% 21 - 30.07.37	970 000	CZK	33 361	35 069	0,10
Czech Republic 2.00% 17 - 13.10.33	3 250 000	CZK	122 690	125 129	0,36
Czech Republic 2.40% 14 - 17.09.25	3 020 000	CZK	133 262	130 666	0,38
Czech Republic 2.50% 13 - 25.08.28	3 320 000	CZK	139 920	141 002	0,40
Czech Republic 2.75% 18 - 23.07.29	3 570 000	CZK	150 465	151 915	0,44
Czech Republic 3.50% 22 - 30.05.35	1 340 000	CZK	57 741	58 611	0,17
Czech Republic 4.20% 06 - 04.12.36	1 840 000	CZK	81 862	85 826	0,25
Czech Republic 4.50% 23 - 11.11.32	670 000	CZK	28 752	31 717	0,09
Czech Republic 4.90% 23 - 14.04.34	1 350 000	CZK	65 282	66 348	0,19
Czech Republic 5.00% 22 - 30.09.30	3 170 000	CZK	147 801	152 695	0,44
Czech Republic 5.50% 22 - 12.12.28	2 060 000	CZK	100 214	100 006	0,29
Czech Republic 5.75% 23 - 29.03.29	1 150 000	CZK	52 803	56 381	0,16
Czech Republic 6.00% 22 - 26.02.26	2 420 000	CZK	113 907	112 860	0,32
Czech Republic 6.20% 23 - 16.06.31	750 000	CZK	37 711	38 993	0,11
			2 142 637	2 164 094	6,22
Égypte					
Egypt 14.06% 21 - 12.01.26	3 903 000	EGP	111 910	109 573	0,31
Egypt 14.292% 21 - 05.01.28	624 000	EGP	16 053	15 961	0,05
Egypt 14.369% 20 - 20.10.25	785 000	EGP	22 528	22 440	0,06
Egypt 14.40% 19 - 10.09.29	401 000	EGP	9 703	9 705	0,03
Egypt 14.483% 21 - 06.04.26	1 139 000	EGP	31 857	31 782	0,09
Egypt 14.531% 21 - 14.09.24	2 500 000	EGP	76 982	75 073	0,22
Egypt 14.556% 20 - 13.10.27	700 000	EGP	18 231	18 208	0,05
Egypt 14.563% 21 - 06.07.26	353 000	EGP	9 757	9 747	0,03
Egypt 14.664% 20 - 06.10.30	423 000	EGP	10 231	10 067	0,03
Egypt 16.10% 19 - 07.05.29	464 000	EGP	12 082	12 122	0,03
			319 334	314 678	0,90

Xtrackers II

Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Hongrie					
Hungary 1.00% 19 - 26.11.25	30 120 000	HUF	74 665	79 143	0,23
Hungary 1.50% 20 - 22.04.26	29 460 000	HUF	71 365	76 760	0,22
Hungary 1.50% 21 - 26.08.26	16 920 000	HUF	40 746	43 540	0,12
Hungary 2.00% 20 - 23.05.29	20 010 000	HUF	43 237	48 288	0,14
Hungary 2.25% 20 - 20.04.33	31 730 000	HUF	61 198	69 535	0,20
Hungary 2.25% 21 - 22.06.34	8 370 000	HUF	15 683	17 649	0,05
Hungary 2.50% 18 - 24.10.24	27 350 000	HUF	74 186	76 188	0,22
Hungary 2.75% 17 - 22.12.26	19 790 000	HUF	47 066	52 104	0,15
Hungary 3.00% 16 - 27.10.27	25 830 000	HUF	60 303	67 998	0,20
Hungary 3.00% 18 - 27.10.38	22 920 000	HUF	39 449	46 447	0,13
Hungary 3.00% 19 - 21.08.30	25 430 000	HUF	55 250	63 010	0,18
Hungary 3.00% 20 - 25.04.41	11 820 000	HUF	20 397	23 109	0,07
Hungary 3.25% 15 - 22.10.31	31 460 000	HUF	69 571	77 370	0,22
Hungary 4.50% 22 - 23.03.28	13 170 000	HUF	33 411	36 303	0,10
Hungary 4.75% 22 - 24.11.32	30 360 000	HUF	70 404	81 043	0,23
Hungary 5.50% 14 - 24.06.25	25 070 000	HUF	67 886	71 609	0,21
Hungary 6.75% 11 - 22.10.28	37 870 000	HUF	103 629	113 691	0,33
Hungary 9.50% 23 - 21.10.26	15 380 000	HUF	45 461	48 165	0,14
			993 907	1 091 952	3,14
Indonésie					
Indonesia Zero Coupon 21 - 15.06.42	1 753 000 000	IDR	120 279	118 718	0,34
Indonesia 5.125% 21 - 15.04.27	1 674 000 000	IDR	108 909	105 135	0,30
Indonesia 5.50% 20 - 15.04.26	2 139 000 000	IDR	139 906	136 492	0,39
Indonesia 6.125% 12 - 15.05.28	1 631 000 000	IDR	108 497	105 029	0,30
Indonesia 6.25% 21 - 15.06.36	713 000 000	IDR	47 618	45 243	0,13
Indonesia 6.375% 21 - 15.04.32	2 709 000 000	IDR	178 497	174 360	0,50
Indonesia 6.375% 22 - 15.07.37	242 000 000	IDR	16 057	15 482	0,04
Indonesia 6.375% 22 - 15.08.28	1 474 000 000	IDR	98 941	95 781	0,28
Indonesia 6.50% 19 - 15.06.25	2 095 000 000	IDR	141 039	136 373	0,39
Indonesia 6.50% 20 - 15.02.31	2 688 000 000	IDR	179 337	174 475	0,50
Indonesia 6.625% 12 - 15.05.33	1 358 000 000	IDR	92 300	88 816	0,26
Indonesia 6.625% 23 - 15.02.34	1 018 000 000	IDR	64 504	66 693	0,19
Indonesia 6.875% 23 - 15.04.29	796 000 000	IDR	52 226	52 594	0,15
Indonesia 7.00% 11 - 15.05.27	1 725 000 000	IDR	118 315	114 276	0,33
Indonesia 7.00% 19 - 15.09.30	2 467 000 000	IDR	169 990	164 552	0,47
Indonesia 7.00% 22 - 15.02.33	2 215 000 000	IDR	152 847	149 398	0,43
Indonesia 7.125% 22 - 15.06.43	723 000 000	IDR	49 953	48 882	0,14
Indonesia 7.125% 22 - 15.06.38	995 000 000	IDR	67 756	67 757	0,19
Indonesia 7.50% 16 - 15.08.32	666 000 000	IDR	48 186	45 872	0,13
Indonesia 7.50% 17 - 15.05.38	1 116 000 000	IDR	78 007	77 737	0,22
Indonesia 7.50% 19 - 15.06.35	1 837 000 000	IDR	130 347	128 317	0,37
Indonesia 7.50% 19 - 15.04.40	2 215 000 000	IDR	157 909	154 152	0,44
Indonesia 8.25% 11 - 15.06.32	741 000 000	IDR	54 462	53 252	0,15
Indonesia 8.25% 15 - 15.05.36	1 491 000 000	IDR	110 045	109 910	0,32
Indonesia 8.25% 18 - 15.05.29	1 785 000 000	IDR	128 195	125 380	0,36
Indonesia 8.375% 10 - 15.09.26	1 789 000 000	IDR	126 541	122 059	0,35
Indonesia 8.375% 13 - 15.03.34	2 160 000 000	IDR	163 811	158 805	0,46
Indonesia 8.375% 19 - 15.04.39	838 000 000	IDR	62 540	62 862	0,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Indonésie (suite)					
Indonesia 8.75% 15 - 15.05.31	1 037 000 000	IDR	77 938	75 837	0,22
Indonesia 9.00% 13 - 15.03.29	1 479 000 000	IDR	109 532	106 336	0,31
Indonesia 9.50% 10 - 15.07.31	355 000 000	IDR	27 899	26 999	0,08
Indonesia 10.50% 09 - 15.08.30	508 000 000	IDR	40 185	40 005	0,12
Indonesia 11.00% 06 - 15.09.25	301 000 000	IDR	21 818	20 976	0,06
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4.875% 21 - 15.07.26	704 000 000	IDR	46 004	43 874	0,13
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 6.625% 19 - 15.10.24	791 000 000	IDR	53 294	51 462	0,15
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 6.875% 23 - 15.03.36	987 000 000	IDR	66 554	65 078	0,19
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 8.875% 16 - 15.11.31	1 250 000 000	IDR	95 901	91 856	0,26
			3 506 139	3 420 825	9,83
Malaisie					
Malaysia Zero Coupon 22 - 15.07.32	379 000	MYR	83 364	81 184	0,23
Malaysia 2.632% 20 - 15.04.31	330 000	MYR	68 619	66 695	0,19
Malaysia 3.422% 20 - 30.09.27	526 000	MYR	116 861	114 125	0,33
Malaysia 3.447% 21 - 15.07.36	464 000	MYR	96 482	95 877	0,28
Malaysia 3.465% 20 - 15.10.30	506 000	MYR	111 045	107 833	0,31
Malaysia 3.502% 07 - 31.05.27	387 000	MYR	85 759	84 083	0,24
Malaysia 3.519% 23 - 20.04.28	312 000	MYR	67 638	67 771	0,19
Malaysia 3.599% 23 - 31.07.28	266 000	MYR	57 625	57 877	0,17
Malaysia 3.655% 19 - 15.10.24	398 000	MYR	88 358	86 794	0,25
Malaysia 3.726% 19 - 31.03.26	431 000	MYR	97 623	94 406	0,27
Malaysia 3.733% 13 - 15.06.28	482 000	MYR	108 713	105 413	0,30
Malaysia 3.757% 19 - 22.05.40	478 000	MYR	101 612	99 701	0,29
Malaysia 3.828% 19 - 05.07.34	584 000	MYR	129 400	126 609	0,36
Malaysia 3.882% 18 - 14.03.25	369 000	MYR	82 945	80 774	0,23
Malaysia 3.885% 19 - 15.08.29	427 000	MYR	95 775	93 946	0,27
Malaysia 3.899% 17 - 16.11.27	414 000	MYR	94 223	91 282	0,26
Malaysia 3.90% 16 - 30.11.26	475 000	MYR	106 464	104 681	0,30
Malaysia 3.906% 19 - 15.07.26	397 000	MYR	89 582	87 369	0,25
Malaysia 3.955% 15 - 15.09.25	530 000	MYR	118 947	116 538	0,34
Malaysia 3.99% 15 - 15.10.25	514 000	MYR	115 125	113 102	0,33
Malaysia 4.059% 17 - 30.09.24	186 000	MYR	41 963	40 737	0,12
Malaysia 4.065% 20 - 15.06.50	505 000	MYR	109 678	106 605	0,31
Malaysia 4.07% 16 - 30.09.26	492 000	MYR	107 206	108 639	0,31
Malaysia 4.128% 18 - 15.08.25	211 000	MYR	47 947	46 494	0,13
Malaysia 4.13% 19 - 09.07.29	406 000	MYR	92 196	90 136	0,26
Malaysia 4.193% 22 - 07.10.32	409 000	MYR	92 931	91 510	0,26
Malaysia 4.245% 15 - 30.09.30	460 000	MYR	104 221	103 087	0,30
Malaysia 4.254% 15 - 31.05.35	272 000	MYR	62 718	60 909	0,18
Malaysia 4.258% 17 - 26.07.27	186 000	MYR	42 791	41 425	0,12
Malaysia 4.291% 23 - 14.08.43	262 000	MYR	58 054	58 518	0,17
Malaysia 4.369% 18 - 31.10.28	464 000	MYR	106 950	104 245	0,30
Malaysia 4.417% 21 - 30.09.41	359 000	MYR	82 353	80 965	0,23
Malaysia 4.457% 23 - 31.03.53	255 000	MYR	58 964	57 523	0,17

Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Malaisie (suite)					
Malaysia 4.504% 22 - 30.04.29	169 000	MYR	39 449	38 283	0,11
Malaysia 4.642% 18 - 07.11.33	300 000	MYR	68 697	70 149	0,20
Malaysia 4.662% 22 - 31.03.38	169 000	MYR	40 954	39 574	0,11
Malaysia 4.696% 22 - 15.10.42	470 000	MYR	112 128	110 271	0,32
Malaysia 4.762% 17 - 07.04.37	480 000	MYR	115 374	112 627	0,32
Malaysia 4.893% 18 - 08.06.38	497 000	MYR	120 514	118 857	0,34
Malaysia 4.921% 18 - 06.07.48	318 000	MYR	80 279	76 186	0,22
			3 501 527	3 432 800	9,87
Mexique					
Mexico 5.00% 21 - 06.03.25	2 200 000	MXN	117 488	122 930	0,35
Mexico 5.50% 21 - 04.03.27	5 477 500	MXN	277 740	289 449	0,83
Mexico 5.75% 15 - 05.03.26	6 610 000	MXN	344 134	360 199	1,03
Mexico 7.00% 23 - 03.09.26	2 100 000	MXN	111 670	116 644	0,33
Mexico 7.50% 07 - 03.06.27	4 827 400	MXN	258 986	270 606	0,78
Mexico 7.50% 22 - 26.05.33	3 930 000	MXN	202 712	211 067	0,61
Mexico 7.75% 11 - 29.05.31	6 390 000	MXN	337 408	352 806	1,01
Mexico 7.75% 12 - 13.11.42	4 640 000	MXN	229 710	242 150	0,70
Mexico 7.75% 14 - 23.11.34	1 306 100	MXN	69 023	70 706	0,20
Mexico 8.00% 17 - 07.11.47	4 250 700	MXN	216 255	225 152	0,65
Mexico 8.00% 19 - 05.09.24	3 880 000	MXN	213 914	224 987	0,65
Mexico 8.00% 22 - 31.07.53	2 715 100	MXN	134 611	142 992	0,41
Mexico 8.00% 23 - 24.05.35	300 000	MXN	16 218	16 222	0,05
Mexico 8.50% 09 - 31.05.29	4 360 000	MXN	241 472	252 498	0,73
Mexico 8.50% 09 - 18.11.38	3 630 000	MXN	195 875	205 104	0,59
Mexico 8.50% 23 - 01.03.29	867 900	MXN	45 623	50 065	0,14
Mexico 10.00% 05 - 05.12.24	3 229 700	MXN	180 118	189 704	0,54
Mexico 10.00% 06 - 20.11.36	1 180 000	MXN	72 110	75 211	0,22
			3 265 067	3 418 492	9,82
Pérou					
Peru 5.35% 19 - 12.08.40	184 000	PEN	40 350	42 578	0,12
Peru 5.40% 19 - 12.08.34	320 000	PEN	75 294	78 119	0,22
Peru 5.70% 14 - 12.08.24	75 000	PEN	20 277	20 270	0,06
Peru 5.94% 18 - 12.02.29	367 000	PEN	94 964	99 096	0,29
Peru 6.15% 17 - 12.08.32	444 000	PEN	111 302	117 159	0,34
Peru 6.35% 16 - 12.08.28	248 000	PEN	65 723	68 534	0,20
Peru 6.90% 07 - 12.08.37	376 000	PEN	96 748	102 243	0,29
Peru 6.95% 08 - 12.08.31	379 000	PEN	100 772	105 841	0,30
Peru 8.20% 06 - 12.08.26	165 000	PEN	45 955	47 370	0,14
Peru 144A 7.30% 23 - 12.08.33	384 000	PEN	108 325	108 651	0,31
			759 710	789 861	2,27
Pologne					
Poland Zero Coupon 22 - 25.10.25	486 000	PLN	104 677	113 147	0,32
Poland 0.25% 21 - 25.10.26	687 000	PLN	140 811	153 566	0,44
Poland 0.75% 20 - 25.04.25	611 000	PLN	136 886	147 170	0,42
Poland 1.25% 20 - 25.10.30	901 000	PLN	162 969	181 517	0,52
Poland 1.75% 21 - 25.04.32	765 000	PLN	135 192	151 449	0,44
Poland 2.25% 19 - 25.10.24	652 000	PLN	151 124	162 136	0,47
Poland 2.50% 15 - 25.07.26	1 046 000	PLN	230 979	250 625	0,72

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Pologne (suite)					
Poland 2.50% 16 - 25.07.27	687 000	PLN	146 862	161 395	0,46
Poland 2.75% 13 - 25.04.28	870 000	PLN	185 083	202 917	0,58
Poland 2.75% 19 - 25.10.29	1 034 000	PLN	211 696	234 997	0,68
Poland 3.25% 14 - 25.07.25	906 000	PLN	210 108	224 391	0,64
Poland 3.75% 22 - 25.05.27	737 000	PLN	165 037	180 625	0,52
Poland 6.00% 22 - 25.10.33	692 000	PLN	173 190	186 610	0,54
Poland 7.50% 22 - 25.07.28	989 000	PLN	251 735	276 746	0,80
			2 406 349	2 627 291	7,55
Roumanie					
Romania 2.50% 21 - 25.10.27	240 000	RON	45 399	46 842	0,14
Romania 3.25% 20 - 24.06.26	280 000	RON	56 872	58 232	0,17
Romania 3.50% 21 - 25.11.25	280 000	RON	58 419	59 443	0,17
Romania 3.65% 16 - 24.09.31	275 000	RON	48 923	51 585	0,15
Romania 3.65% 20 - 28.07.25	265 000	RON	55 903	56 820	0,16
Romania 3.70% 20 - 25.11.24	260 000	RON	55 781	56 602	0,16
Romania 4.15% 20 - 26.01.28	275 000	RON	54 475	56 826	0,16
Romania 4.15% 20 - 24.10.30	265 000	RON	49 545	52 340	0,15
Romania 4.25% 21 - 28.04.36	215 000	RON	35 961	39 655	0,11
Romania 4.75% 14 - 24.02.25	270 000	RON	58 722	59 139	0,17
Romania 4.75% 19 - 11.10.34	275 000	RON	49 834	53 956	0,16
Romania 4.85% 18 - 22.04.26	270 000	RON	57 478	58 421	0,17
Romania 4.85% 21 - 25.07.29	315 000	RON	62 414	65 562	0,19
Romania 5.00% 18 - 12.02.29	265 000	RON	53 489	55 797	0,16
Romania 5.80% 12 - 26.07.27	320 000	RON	68 335	70 272	0,20
Romania 6.70% 22 - 25.02.32	325 000	RON	69 778	74 034	0,21
Romania 7.20% 23 - 28.10.26	205 000	RON	46 400	46 644	0,13
Romania 7.20% 23 - 31.05.27	105 000	RON	23 124	23 983	0,07
Romania 7.20% 23 - 30.10.33	115 000	RON	25 969	27 369	0,08
Romania 7.35% 23 - 28.04.31	155 000	RON	35 127	36 488	0,11
Romania 7.90% 23 - 24.02.38	260 000	RON	62 705	66 606	0,19
Romania 8.00% 23 - 29.04.30	220 000	RON	50 329	53 229	0,15
Romania 8.25% 22 - 29.09.32	310 000	RON	72 893	78 029	0,23
Romania 8.75% 22 - 30.10.28	315 000	RON	73 319	77 157	0,22
			1 271 194	1 325 031	3,81
Afrique du Sud					
South Africa 6.25% 06 - 31.03.36	2 126 000	ZAR	74 525	76 405	0,22
South Africa 6.50% 10 - 28.02.41	1 978 150	ZAR	62 526	65 520	0,19
South Africa 7.00% 10 - 28.02.31	4 031 370	ZAR	173 533	184 747	0,53
South Africa 8.00% 13 - 31.01.30	7 757 400	ZAR	366 007	390 502	1,12
South Africa 8.25% 14 - 31.03.32	6 822 600	ZAR	305 237	326 028	0,94
South Africa 8.50% 13 - 31.01.37	5 999 700	ZAR	243 474	256 041	0,73
South Africa 8.75% 12 - 28.02.48	8 660 106	ZAR	336 602	348 982	1,00
South Africa 8.75% 14 - 31.01.44	5 210 000	ZAR	203 358	211 342	0,61
South Africa 8.875% 15 - 28.02.35	6 626 500	ZAR	290 179	306 000	0,88
South Africa 9.00% 15 - 31.01.40	5 035 839	ZAR	207 149	214 806	0,62
South Africa 10.50% 98 - 21.12.26	8 001 067	ZAR	436 844	458 061	1,32
South Africa 11.625% 23 - 31.03.53	550 000	ZAR	26 484	28 802	0,08
			2 725 918	2 867 236	8,24

Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Thaïlande					
Thailand 0.75% 21 - 17.09.24	5 355 000	THB	154 728	155 102	0,45
Thailand 0.95% 20 - 17.06.25	4 860 000	THB	140 836	139 482	0,40
Thailand 1.00% 21 - 17.06.27	6 789 000	THB	191 266	189 557	0,54
Thailand 1.45% 19 - 17.12.24	5 040 000	THB	147 241	146 519	0,42
Thailand 1.585% 20 - 17.12.35	4 326 000	THB	112 842	112 146	0,32
Thailand 1.60% 19 - 17.06.35	2 190 000	THB	58 403	57 168	0,16
Thailand 1.60% 19 - 17.12.29	4 659 000	THB	130 169	129 625	0,37
Thailand 2.00% 20 - 17.06.42	3 177 000	THB	80 090	78 794	0,23
Thailand 2.00% 21 - 17.12.31	7 173 000	THB	202 477	200 635	0,58
Thailand 2.125% 16 - 17.12.26	4 949 000	THB	144 966	143 993	0,41
Thailand 2.25% 23 - 17.03.27	3 213 000	THB	88 645	93 655	0,27
Thailand 2.35% 22 - 17.06.26	4 693 000	THB	138 690	137 395	0,40
Thailand 2.40% 23 - 17.03.29	1 841 000	THB	49 865	53 807	0,15
Thailand 2.65% 22 - 17.06.28	6 109 000	THB	181 637	180 562	0,52
Thailand 2.875% 16 - 17.06.46	3 852 000	THB	108 257	103 544	0,30
Thailand 2.875% 18 - 17.12.28	4 122 000	THB	124 746	123 190	0,35
Thailand 3.30% 18 - 17.06.38	5 684 000	THB	174 296	172 279	0,50
Thailand 3.35% 22 - 17.06.33	5 532 000	THB	168 551	170 880	0,49
Thailand 3.39% 22 - 17.06.37	4 225 000	THB	126 807	131 056	0,38
Thailand 3.40% 15 - 17.06.36	4 343 000	THB	135 041	134 185	0,39
Thailand 3.45% 22 - 17.06.43	3 572 000	THB	108 572	109 539	0,31
Thailand 3.65% 10 - 20.06.31	4 051 000	THB	129 123	126 910	0,36
Thailand 3.775% 12 - 25.06.32	5 518 000	THB	177 351	175 698	0,51
Thailand 3.85% 10 - 12.12.25	4 589 000	THB	138 291	138 340	0,40
Thailand 4.875% 09 - 22.06.29	5 314 000	THB	175 544	174 605	0,50
			3 388 434	3 378 666	9,71
Turquie					
Turkey 8.00% 15 - 12.03.25	570 000	TRY	20 872	14 340	0,04
Turkey 10.50% 17 - 11.08.27	1 377 000	TRY	58 183	31 495	0,09
Turkey 10.60% 16 - 11.02.26	540 000	TRY	25 077	12 588	0,04
Turkey 11.00% 17 - 24.02.27	642 000	TRY	14 473	14 282	0,04
Turkey 11.70% 20 - 13.11.30	1 246 000	TRY	64 494	27 191	0,08
Turkey 12.40% 18 - 08.03.28	1 720 000	TRY	67 092	39 019	0,11
Turkey 12.60% 20 - 01.10.25	1 421 000	TRY	55 397	34 113	0,10
Turkey 16.90% 21 - 02.09.26	1 114 000	TRY	57 990	28 791	0,08
Turkey 17.30% 23 - 19.07.28	2 694 000	TRY	73 508	73 566	0,21
Turkey 17.80% 23 - 13.07.33	1 250 000	TRY	30 808	33 055	0,10
			467 894	308 440	0,89
Total - Obligations			33 325 431	34 063 501	97,90
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			33 325 431	34 063 501	97,90
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			33 325 431	34 063 501	97,90
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				34 639 275	99,55

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A Zero Coupon 19 - 15.07.24	116 000	EUR	113 713	113 616	1,53
Austria 144A 1.65% 14 - 21.10.24	115 000	EUR	113 320	113 282	1,52
			227 033	226 898	3,05
Belgique					
Belgium 144A 0.50% 17 - 22.10.24	127 000	EUR	124 067	124 270	1,67
Belgium 144A 2.60% 14 - 22.06.24	142 000	EUR	141 272	141 274	1,89
			265 339	265 544	3,56
Croatie					
Croatia 5.75% 13 - 10.07.24	13 000	EUR	13 133	13 154	0,18
			13 133	13 154	0,18
Chypre					
Cyprus 0.625% 19 - 03.12.24	10 000	EUR	9 758	9 725	0,13
			9 758	9 725	0,13
Finlande					
Finland 144A Zero Coupon 19 - 15.09.24	40 000	EUR	38 998	39 034	0,52
Finland 144A 2.00% 14 - 15.04.24	49 000	EUR	48 761	48 757	0,66
			87 759	87 791	1,18
France					
France OAT Zero Coupon 18 - 25.03.24	333 000	EUR	330 240	330 269	4,43
France OAT Zero Coupon 21 - 25.02.24	303 000	EUR	301 348	301 379	4,05
France OAT 1.75% 14 - 25.11.24	351 000	EUR	345 840	346 546	4,65
France OAT 2.25% 13 - 25.05.24	356 000	EUR	354 025	353 950	4,75
			1 331 453	1 332 144	17,88
Allemagne					
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 05.04.24	241 000	EUR	238 756	238 718	3,20
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 18.10.24	214 000	EUR	208 217	208 601	2,80
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.03.24	191 000	EUR	189 628	189 596	2,54
Bundesrepublik Deutschland 0.20% 22 - 14.06.24	168 000	EUR	165 453	165 460	2,22
Bundesrepublik Deutschland 0.40% 22 - 13.09.24	168 000	EUR	164 369	164 591	2,21
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 14 - 15.08.24	214 000	EUR	210 771	210 843	2,83
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 14 - 15.05.24	232 000	EUR	230 247	230 230	3,09
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 14 - 15.02.24	217 000	EUR	216 511	216 455	2,91
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 22 - 12.12.24	157 000	EUR	155 852	155 680	2,09
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 94 - 04.01.24	117 000	EUR	117 027	117 066	1,57
			1 896 831	1 897 240	25,46
Grèce					
Greece 144A 3.45% 19 - 02.04.24	18 000	EUR	18 006	17 988	0,24
			18 006	17 988	0,24
Irlande					
Ireland 3.40% 14 - 18.03.24	79 000	EUR	78 991	78 942	1,06
			78 991	78 942	1,06
Italie					
Italy Zero Coupon 20 - 15.01.24	138 000	EUR	137 794	137 815	1,85
Italy Zero Coupon 21 - 15.04.24	184 000	EUR	181 997	182 014	2,44
Italy Zero Coupon 21 - 15.08.24	174 000	EUR	170 002	170 459	2,29

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 21 - 30.01.24	153 000	EUR	152 511	152 386	2,04
Italy Zero Coupon 21 - 15.12.24	158 000	EUR	153 298	153 213	2,06
Italy 1.45% 17 - 15.11.24	193 000	EUR	189 542	189 872	2,55
Italy 1.75% 19 - 01.07.24	148 000	EUR	146 470	146 505	1,97
Italy 1.75% 22 - 30.05.24	144 000	EUR	142 731	142 776	1,91
Italy 1.85% 17 - 15.05.24	154 000	EUR	152 862	152 891	2,05
Italy 2.50% 14 - 01.12.24	222 000	EUR	220 479	220 344	2,96
Italy 3.75% 14 - 01.09.24	179 000	EUR	178 832	179 176	2,40
Italy 4.50% 13 - 01.03.24	212 000	EUR	212 189	212 131	2,85
			2 038 707	2 039 582	27,37
Pays-Bas					
Netherlands 144A Zero Coupon 17 - 15.01.24	144 000	EUR	143 801	143 816	1,93
Netherlands 144A 2.00% 14 - 15.07.24	178 000	EUR	176 538	176 724	2,37
			320 339	320 540	4,30
Portugal					
Portugal 144A 5.65% 13 - 15.02.24	60 000	EUR	60 147	60 143	0,81
			60 147	60 143	0,81
Slovaquie					
Slovakia Zero Coupon 20 - 17.06.24	23 000	EUR	22 613	22 584	0,30
Slovakia 3.375% 12 - 15.11.24	27 000	EUR	26 992	26 923	0,36
			49 605	49 507	0,66
Slovénie					
Slovenia 4.625% 09 - 09.09.24	14 000	EUR	14 157	14 140	0,19
			14 157	14 140	0,19
Espagne					
Spain Zero Coupon 21 - 31.05.24	193 000	EUR	190 043	190 088	2,55
Spain 0.25% 19 - 30.07.24	184 000	EUR	180 371	180 592	2,42
Spain 144A 2.75% 14 - 31.10.24	232 000	EUR	230 472	230 924	3,10
Spain 144A 3.80% 14 - 30.04.24	204 000	EUR	203 961	203 963	2,74
Spain 144A 4.80% 08 - 31.01.24	169 000	EUR	169 128	169 106	2,27
			973 975	974 673	13,08
Total - Obligations			7 385 233	7 388 011	99,15

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

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

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	Valeur de marché	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs					
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	20	EUR	200 589	200 992	2,70
			200 589	200 992	2,70
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			200 589	200 992	2,70
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			7 585 822	7 589 003	101,85
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			7 585 822	7 589 003	101,85
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				7 641 956	102,56

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 144A Zero Coupon 19 - 15.07.24	136 000	EUR	133 451	133 205	2,34
Austria 144A 1.65% 14 - 21.10.24	134 000	EUR	131 971	131 999	2,32
			265 422	265 204	4,66
Belgique					
Belgium 144A 0.50% 17 - 22.10.24	146 000	EUR	142 608	142 861	2,51
Belgium 144A 2.60% 14 - 22.06.24	169 000	EUR	168 113	168 136	2,96
			310 721	310 997	5,47
France					
France OAT Zero Coupon 18 - 25.03.24	390 000	EUR	386 737	386 802	6,80
France OAT Zero Coupon 21 - 25.02.24	354 000	EUR	352 055	352 106	6,19
France OAT 1.75% 14 - 25.11.24	410 000	EUR	403 935	404 797	7,11
France OAT 2.25% 13 - 25.05.24	415 000	EUR	412 633	412 610	7,25
			1 555 360	1 556 315	27,35
Italie					
Italy Zero Coupon 20 - 15.01.24	165 000	EUR	164 757	164 779	2,90
Italy Zero Coupon 21 - 15.04.24	215 000	EUR	212 674	212 679	3,74
Italy Zero Coupon 21 - 15.08.24	202 000	EUR	197 427	197 889	3,48
Italy Zero Coupon 21 - 30.01.24	171 000	EUR	170 468	170 314	2,99
Italy Zero Coupon 21 - 15.12.24	187 000	EUR	181 435	181 334	3,19
Italy 1.45% 17 - 15.11.24	215 000	EUR	211 125	211 515	3,72
Italy 1.75% 19 - 01.07.24	180 000	EUR	178 135	178 182	3,13
Italy 1.75% 22 - 30.05.24	161 000	EUR	159 596	159 632	2,80
Italy 1.85% 17 - 15.05.24	178 000	EUR	176 692	176 718	3,10
Italy 2.50% 14 - 01.12.24	260 000	EUR	258 219	258 060	4,53
Italy 3.75% 14 - 01.09.24	217 000	EUR	216 857	217 214	3,82
Italy 4.50% 13 - 01.03.24	254 000	EUR	254 231	254 157	4,47
			2 381 616	2 382 473	41,87
Espagne					
Spain Zero Coupon 21 - 31.05.24	223 000	EUR	219 580	219 635	3,86
Spain 0.25% 19 - 30.07.24	203 000	EUR	199 003	199 241	3,50
Spain 144A 2.75% 14 - 31.10.24	278 000	EUR	276 121	276 710	4,86
Spain 144A 3.80% 14 - 30.04.24	243 000	EUR	242 951	242 956	4,27
Spain 144A 4.80% 08 - 31.01.24	200 000	EUR	200 144	200 126	3,52
			1 137 799	1 138 668	20,01
Total - Obligations			5 650 918	5 653 657	99,36
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			5 650 918	5 653 657	99,36
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			5 650 918	5 653 657	99,36
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				5 689 402	99,99

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 19 - 05.04.24	30 478 000	EUR	30 190 423	30 189 373	11,94
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 19 - 18.10.24	29 181 000	EUR	28 446 133	28 444 763	11,25
Bundesrepublik Deutschland Zero Coupon 22 - 15.03.24	25 290 000	EUR	25 107 663	25 104 119	9,93
Bundesrepublik Deutschland 0.20% 22 - 14.06.24	22 048 000	EUR	21 721 078	21 714 634	8,59
Bundesrepublik Deutschland 0.40% 22 - 13.09.24	22 048 000	EUR	21 603 433	21 600 646	8,54
Bundesrepublik Deutschland 1.00% 14 - 15.08.24	29 181 000	EUR	28 756 441	28 750 580	11,37
Bundesrepublik Deutschland 1.50% 14 - 15.05.24	29 181 000	EUR	28 966 271	28 958 349	11,45
Bundesrepublik Deutschland 1.75% 14 - 15.02.24	29 181 000	EUR	29 119 756	29 107 756	11,51
Bundesrepublik Deutschland 2.20% 22 - 12.12.24	20 751 000	EUR	20 599 310	20 576 484	8,13
Bundesrepublik Deutschland 6.25% 94 - 04.01.24	16 459 000	EUR	16 463 658	16 468 217	6,51
			250 974 166	250 914 921	99,22
Total - Obligations			250 974 166	250 914 921	99,22
Fonds commun de placement/Fonds à capital variable					
Irlande					
Deutsche Global Liquidity Series PLC - Managed Euro Fund	1 258	EUR	12 627 037	12 642 425	5,00
			12 627 037	12 642 425	5,00
Total des fonds communs de placement/fonds à capital variable			12 627 037	12 642 425	5,00
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			263 601 203	263 557 346	104,22
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			263 601 203	263 557 346	104,22
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				265 489 348	104,98

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Westpac Banking Corp. 1.125% 17 - 05.09.27	100 000	EUR	90 642	92 987	0,36
			90 642	92 987	0,36
Autriche					
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 4.125% 23 - 18.01.27	100 000	EUR	98 624	101 411	0,39
Raiffeisen Bank International AG FRN 20 - 18.06.32	100 000	EUR	83 537	89 609	0,35
			182 161	191 020	0,74
Belgique					
AG Insurance SA FRN 15 - 30.06.47	100 000	EUR	93 181	95 980	0,37
KBC Group NV FRN 21 - 07.12.31	100 000	EUR	87 603	90 250	0,35
KBC Group NV FRN 22 - 23.11.27	100 000	EUR	100 212	102 349	0,40
			280 996	288 579	1,12
Canada					
Bank of Montreal 2.75% 22 - 15.06.27	100 000	EUR	95 429	98 363	0,38
Mercedes-Benz Finance Canada Inc. 3.00% 22 - 23.02.27	148 000	EUR	145 617	148 164	0,58
Toronto-Dominion Bank 0.50% 22 - 18.01.27	100 000	EUR	89 768	92 583	0,36
Toronto-Dominion Bank 2.551% 22 - 03.08.27	100 000	EUR	94 797	97 839	0,38
			425 611	436 949	1,70
République tchèque					
Ceska sporitelna AS FRN 21 - 13.09.28	100 000	EUR	84 480	86 471	0,34
			84 480	86 471	0,34
Danemark					
ISS Global A/S 1.50% 17 - 31.08.27	100 000	EUR	90 499	93 358	0,36
Nykredit Realkredit AS 0.75% 20 - 20.01.27	100 000	EUR	89 576	92 009	0,36
			180 075	185 367	0,72
Finlande					
Kojamo OYJ 1.875% 20 - 27.05.27	100 000	EUR	87 292	89 394	0,35
Nordea Bank Abp 1.125% 17 - 27.09.27	100 000	EUR	91 783	94 405	0,37
Nordea Bank Abp 1.125% 22 - 16.02.27	200 000	EUR	183 987	187 874	0,73
OP Corporate Bank PLC 0.625% 22 - 27.07.27	100 000	EUR	88 307	90 818	0,35
			451 369	462 491	1,80
France					
ALD SA 4.25% 23 - 18.01.27	100 000	EUR	99 885	102 233	0,40
Alstom SA 0.25% 19 - 14.10.26	100 000	EUR	88 479	90 586	0,35
APRR SA 1.25% 20 - 14.01.27	100 000	EUR	93 170	95 256	0,37
Arkema SA 1.50% 17 - 20.04.27	100 000	EUR	93 491	95 259	0,37
Autoroutes du Sud de la France SA 1.25% 17 - 18.01.27	100 000	EUR	92 930	95 415	0,37
AXA SA FRN 16 - 06.07.47	100 000	EUR	95 070	97 900	0,38
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 17 - 26.05.27	100 000	EUR	91 362	93 797	0,36
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 16 - 04.11.26	100 000	EUR	93 861	95 715	0,37
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.125% 22 - 14.09.27	100 000	EUR	96 986	99 661	0,39

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 22 - 16.06.32	100 000	EUR	95 417	98 773	0,38
BNP Paribas SA FRN 20 - 14.10.27	100 000	EUR	92 317	92 251	0,36
BNP Paribas SA FRN 20 - 19.02.28	100 000	EUR	88 583	90 997	0,35
BNP Paribas SA FRN 20 - 01.09.28	100 000	EUR	86 929	89 708	0,35
BNP Paribas SA FRN 21 - 30.05.28	100 000	EUR	87 997	90 546	0,35
BNP Paribas SA FRN 20 - 15.01.32	100 000	EUR	87 619	91 187	0,35
BNP Paribas SA 2.25% 16 - 11.01.27	200 000	EUR	189 784	194 330	0,76
BNP Paribas SA FRN 22 - 31.03.32	100 000	EUR	90 917	94 645	0,37
Bouygues SA 1.375% 16 - 07.06.27	100 000	EUR	92 770	95 220	0,37
BPCE SA 0.50% 19 - 24.02.27	100 000	EUR	89 533	91 560	0,36
BPCE SA 1.75% 22 - 26.04.27	100 000	EUR	93 279	95 728	0,37
BPCE SA FRN 22 - 02.03.32	100 000	EUR	90 456	93 631	0,36
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 6.00% 17 - 23.01.27	100 000	EUR	104 883	107 436	0,42
Carmila SA 1.625% 20 - 30.05.27	100 000	EUR	89 019	92 449	0,36
Carrefour SA 1.875% 22 - 30.10.26	100 000	EUR	94 630	96 666	0,38
Cie de Saint-Gobain 1.375% 17 - 14.06.27	100 000	EUR	92 910	94 834	0,37
Credit Agricole SA 1.375% 17 - 03.05.27	200 000	EUR	185 377	189 524	0,74
Credit Agricole SA 1.875% 16 - 20.12.26	100 000	EUR	94 275	96 271	0,37
Credit Agricole SA 2.625% 15 - 17.03.27	129 000	EUR	122 009	125 131	0,49
Credit Agricole SA 3.375% 22 - 28.07.27	100 000	EUR	98 057	100 700	0,39
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 20 - 07.05.27	100 000	EUR	90 545	92 501	0,36
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 22 - 19.09.27	100 000	EUR	97 390	100 411	0,39
Danone SA 0.571% 20 - 17.03.27	100 000	EUR	91 861	93 826	0,36
Edenred 1.875% 17 - 30.03.27	100 000	EUR	94 310	96 466	0,37
ELO SACA 3.25% 20 - 23.07.27	100 000	EUR	94 501	97 056	0,38
Firmenich Productions Participations SAS 1.375% 20 - 30.10.26	100 000	EUR	94 416	95 951	0,37
HSBC Continental Europe SA 0.10% 19 - 03.09.27	100 000	EUR	87 466	89 728	0,35
ICADE 1.50% 17 - 13.09.27	100 000	EUR	90 862	93 032	0,36
Imerys SA 1.50% 17 - 15.01.27	100 000	EUR	93 017	93 748	0,36
Kering SA 3.625% 23 - 05.09.27	100 000	EUR	100 365	102 268	0,40
Klepierre SA 1.375% 17 - 16.02.27	100 000	EUR	92 655	94 768	0,37
Orange SA 1.25% 20 - 07.07.27	200 000	EUR	185 606	189 494	0,74
Orange SA FRN 14 - 29.10.49	100 000	EUR	100 328	102 072	0,40
RCI Banque SA 1.125% 20 - 15.01.27	48 000	EUR	43 832	44 920	0,17
RCI Banque SA 4.50% 23 - 06.04.27	48 000	EUR	47 991	49 310	0,19
RCI Banque SA 4.625% 23 - 02.10.26	48 000	EUR	48 301	49 249	0,19
RCI Banque SA 4.75% 22 - 06.07.27	32 000	EUR	32 283	33 398	0,13
Sanofi 0.50% 16 - 13.01.27	100 000	EUR	91 795	93 839	0,36
Schneider Electric SE 1.375% 18 - 21.06.27	100 000	EUR	93 247	95 378	0,37
Societe Generale SA 0.25% 21 - 08.07.27	100 000	EUR	87 794	90 028	0,35
Societe Generale SA FRN 21 - 02.12.27	100 000	EUR	89 347	91 675	0,36
Societe Generale SA FRN 20 - 22.09.28	100 000	EUR	87 827	90 758	0,35
Societe Generale SA 4.125% 23 - 02.06.27	200 000	EUR	200 597	205 168	0,80
Sodexo SA 0.75% 16 - 14.04.27	100 000	EUR	92 496	94 841	0,37
Unibail-Rodamco-Westfield SE 0.625% 20 - 04.05.27	100 000	EUR	88 673	91 447	0,36

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Wendel SE 2.50% 15 - 09.02.27	100 000	EUR	95 190	96 784	0,38
WPP Finance SA 2.375% 20 - 19.05.27	100 000	EUR	95 337	98 055	0,38
			5 420 027	5 553 580	21,58
Allemagne					
Allianz SE FRN 17 - 06.07.47	100 000	EUR	94 911	97 933	0,38
Berlin Hyp AG 0.375% 22 - 25.01.27	100 000	EUR	90 280	92 158	0,36
Commerzbank AG 0.375% 20 - 01.09.27	48 000	EUR	42 432	43 892	0,17
Commerzbank AG 0.50% 19 - 04.12.26	65 000	EUR	58 932	60 542	0,23
Commerzbank AG FRN 22 - 21.03.28	100 000	EUR	99 100	102 337	0,40
Deutsche Bank AG 1.625% 20 - 20.01.27	200 000	EUR	182 833	187 934	0,73
Deutsche Bank AG FRN 22 - 23.02.28	100 000	EUR	90 642	93 989	0,36
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.05.28	100 000	EUR	94 062	97 867	0,38
Deutsche Bank AG FRN 22 - 24.06.32	100 000	EUR	90 618	96 170	0,37
Deutsche Boerse AG FRN 20 - 16.06.47	100 000	EUR	89 635	90 345	0,35
Deutsche Pfandbriefbank AG 5.00% 23 - 05.02.27	32 000	EUR	32 404	32 771	0,13
Deutsche Telekom AG 0.50% 19 - 05.07.27	20 000	EUR	18 282	18 666	0,07
Evonik Industries AG 2.25% 22 - 25.09.27	100 000	EUR	94 105	96 705	0,38
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 0.625% 19 - 30.11.26	39 000	EUR	34 850	35 686	0,14
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 3.875% 22 - 20.09.27	48 000	EUR	47 168	48 812	0,19
Hamburg Commercial Bank AG 4.875% 23 - 30.03.27	32 000	EUR	31 451	32 349	0,13
Hella GmbH & Co. KGaA 0.50% 19 - 26.01.27	32 000	EUR	28 578	29 159	0,11
Henkel AG & Co. KGaA 2.625% 22 - 13.09.27	100 000	EUR	98 568	99 431	0,39
HOCHTIEF AG 0.50% 19 - 03.09.27	32 000	EUR	28 417	29 065	0,11
LANXESS AG Zero Coupon 21 - 08.09.27	32 000	EUR	27 144	27 752	0,11
LANXESS AG 1.00% 16 - 07.10.26	32 000	EUR	29 553	30 125	0,12
Merck Financial Services GmbH 0.375% 19 - 05.07.27	100 000	EUR	90 187	91 851	0,36
Robert Bosch GmbH 3.625% 23 - 02.06.27	100 000	EUR	100 190	102 129	0,40
Vier Gas Transport GmbH 4.00% 22 - 26.09.27	100 000	EUR	100 816	102 798	0,40
Volkswagen Financial Services AG 0.125% 21 - 12.02.27	100 000	EUR	91 078	90 799	0,35
Vonovia SE 0.375% 21 - 16.06.27	100 000	EUR	86 669	89 400	0,35
Vonovia SE 4.75% 22 - 23.05.27	100 000	EUR	100 749	103 699	0,40
			1 973 654	2 024 364	7,87
Irlande					
AIB Group PLC FRN 22 - 04.04.28	100 000	EUR	92 452	95 899	0,37
Bank of Ireland Group PLC FRN 23 - 16.07.28	100 000	EUR	101 154	104 551	0,41
CA Auto Bank SpA 4.75% 23 - 25.01.27	100 000	EUR	101 041	103 319	0,40
CRH SMW Finance Dac 1.25% 20 - 05.11.26	100 000	EUR	93 191	95 280	0,37
Dell Bank International Dac 0.50% 21 - 27.10.26	100 000	EUR	90 733	92 512	0,36
Fresenius Finance Ireland PLC 2.125% 17 - 01.02.27	45 000	EUR	42 458	43 533	0,17
Grenke Finance PLC 7.875% 23 - 06.04.27	32 000	EUR	33 349	34 524	0,13
Hammerson Ireland Finance Dac 1.75% 21 - 03.06.27	100 000	EUR	88 298	91 564	0,36
Smurfit Kappa Treasury ULC 1.50% 19 - 15.09.27	100 000	EUR	91 343	93 899	0,36
			734 019	755 081	2,93

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
ASTM SpA 1.00% 21 - 25.11.26	100 000	EUR	91 097	93 215	0,36
Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 19 - 19.11.26	100 000	EUR	91 376	93 742	0,37
Intesa Sanpaolo SpA 4.75% 22 - 06.09.27	150 000	EUR	152 026	155 490	0,60
Intesa Sanpaolo SpA FRN 23 - 08.03.28	150 000	EUR	150 392	155 181	0,60
Italgas SpA 1.625% 17 - 19.01.27	100 000	EUR	93 675	95 645	0,37
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA FRN 23 - 14.03.28	100 000	EUR	100 474	103 342	0,40
Snam SpA 0.875% 16 - 25.10.26	100 000	EUR	92 166	94 218	0,37
Terna - Rete Elettrica Nazionale 1.375% 17 - 26.07.27	100 000	EUR	92 086	94 244	0,37
UniCredit SpA FRN 22 - 18.01.28	100 000	EUR	90 388	92 854	0,36
UniCredit SpA 2.125% 16 - 24.10.26	200 000	EUR	191 026	194 892	0,76
			1 144 706	1 172 823	4,56
Japon					
Mizuho Financial Group Inc. 3.49% 22 - 05.09.27	100 000	EUR	97 651	100 356	0,39
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0.75% 20 - 09.07.27	100 000	EUR	90 120	92 615	0,36
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2.25% 18 - 21.11.26	100 000	EUR	95 664	97 702	0,38
			283 435	290 673	1,13
Luxembourg					
Aroundtown SA 0.375% 21 - 15.04.27	100 000	EUR	77 840	80 375	0,31
CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 19 - 25.03.27	100 000	EUR	93 162	95 751	0,37
DH Europe Finance Sarl 1.20% 17 - 30.06.27	100 000	EUR	92 006	94 412	0,37
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.50% 17 - 14.06.27	32 000	EUR	29 686	30 706	0,12
Highland Holdings Sarl 0.318% 21 - 15.12.26	100 000	EUR	90 208	92 263	0,36
Holcim Finance Luxembourg SA 0.125% 21 - 19.07.27	100 000	EUR	88 213	90 658	0,35
Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 19 - 07.03.27	100 000	EUR	92 515	94 525	0,37
Nestle Finance International Ltd. 0.875% 22 - 29.03.27	80 000	EUR	74 207	75 798	0,29
Novartis Finance SA 1.625% 14 - 09.11.26	100 000	EUR	95 361	97 598	0,38
Traton Finance Luxembourg SA 4.50% 23 - 23.11.26	100 000	EUR	102 345	102 159	0,40
			835 543	854 245	3,32
Mexique					
America Movil SAB de CV 0.75% 19 - 26.06.27	100 000	EUR	90 431	92 194	0,36
			90 431	92 194	0,36
Pays-Bas					
ABN AMRO Bank NV 0.60% 20 - 15.01.27	100 000	EUR	89 941	92 298	0,36
ABN AMRO Bank NV 2.375% 22 - 01.06.27	100 000	EUR	95 039	97 334	0,38
ABN AMRO Bank NV 3.875% 23 - 21.12.26	100 000	EUR	99 876	102 037	0,40
ASML Holdings NV 1.625% 16 - 28.05.27	100 000	EUR	94 116	96 074	0,37
BMW Finance NV 0.375% 19 - 24.09.27	48 000	EUR	43 270	44 250	0,17
BMW Finance NV 0.375% 20 - 14.01.27	48 000	EUR	43 800	44 792	0,17
BMW Finance NV 3.25% 23 - 22.11.26	48 000	EUR	47 511	48 416	0,19
Coca-Cola HBC Finance BV 1.00% 19 - 14.05.27	100 000	EUR	91 840	93 697	0,36
Coloplast Finance BV 2.25% 22 - 19.05.27	100 000	EUR	94 982	97 045	0,38
Cooperatieve Rabobank UA FRN 21 - 01.12.27	100 000	EUR	89 695	91 728	0,36

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Cooperatieve Rabobank UA FRN 20 - 05.05.28	100 000	EUR	89 824	92 177	0,36
Cooperatieve Rabobank UA 1.375% 15 - 03.02.27	100 000	EUR	93 633	95 080	0,37
Cooperatieve Rabobank UA 3.913% 23 - 03.11.26	100 000	EUR	100 582	102 263	0,40
Cooperatieve Rabobank UA FRN 22 - 27.01.28	100 000	EUR	101 266	103 546	0,40
CTP NV 0.75% 21 - 18.02.27	100 000	EUR	85 547	89 038	0,35
Deutsche Telekom International Finance BV 1.375% 17 - 30.01.27	130 000	EUR	122 953	124 988	0,48
ING Bank NV 4.125% 23 - 02.10.26	200 000	EUR	201 526	204 892	0,80
ING Groep NV FRN 21 - 29.09.28	100 000	EUR	86 486	88 767	0,34
ING Groep NV FRN 22 - 14.11.27	100 000	EUR	101 514	103 714	0,40
JAB Holdings BV 2.50% 20 - 17.04.27	100 000	EUR	95 390	97 737	0,38
Linde Finance BV 0.25% 20 - 19.05.27	100 000	EUR	89 608	91 839	0,36
Mercedes-Benz International Finance BV 0.375% 19 - 08.11.26	65 000	EUR	59 595	60 686	0,23
Mercedes-Benz International Finance BV 0.625% 19 - 06.05.27	81 000	EUR	74 000	75 412	0,29
Mercedes-Benz International Finance BV 1.50% 18 - 09.02.27	32 000	EUR	30 078	30 750	0,12
Rentokil Initial Finance BV 3.875% 22 - 27.06.27	100 000	EUR	99 376	101 925	0,40
SGS Nederland Holdings BV 0.125% 21 - 21.04.27	100 000	EUR	88 724	90 780	0,35
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.00% 18 - 06.09.27	48 000	EUR	44 428	45 689	0,18
Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.50% 22 - 08.09.27	100 000	EUR	96 832	99 454	0,39
Signify NV 2.375% 20 - 11.05.27	100 000	EUR	93 697	96 975	0,38
Sika Capital BV 3.75% 23 - 03.11.26	100 000	EUR	99 819	101 656	0,39
Stellantis NV 0.625% 21 - 30.03.27	100 000	EUR	90 306	92 150	0,36
Unilever Finance Netherlands BV 1.125% 18 - 12.02.27	100 000	EUR	93 277	95 178	0,37
Universal Music Group NV 3.00% 22 - 30.06.27	100 000	EUR	97 727	100 048	0,39
Upjohn Finance BV 1.362% 20 - 23.06.27	100 000	EUR	89 913	92 842	0,36
Volkswagen International Finance NV 1.875% 17 - 30.03.27	200 000	EUR	191 764	191 164	0,74
Volkswagen International Finance NV FRN 17 - 31.12.99	100 000	EUR	96 152	95 272	0,37
WPC Eurobond BV 2.125% 18 - 15.04.27	100 000	EUR	92 380	94 941	0,37
			3 396 467	3 466 634	13,47
Nouvelle-Zélande					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.20% 21 - 23.09.27	100 000	EUR	87 122	89 434	0,35
ASB Bank Ltd. 4.50% 23 - 16.03.27	100 000	EUR	101 319	103 230	0,40
Westpac Securities NZ Ltd. 0.10% 21 - 13.07.27	100 000	EUR	87 302	89 464	0,35
			275 743	282 128	1,10
Norvège					
DNB Bank ASA FRN 23 - 19.07.28	100 000	EUR	100 805	103 343	0,40
Sparebank 1 Oestlandet 1.75% 22 - 27.04.27	100 000	EUR	93 364	95 102	0,37
			194 169	198 445	0,77
Espagne					
Abertis Infraestructuras SA 1.00% 16 - 27.02.27	100 000	EUR	92 019	94 018	0,37

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Abertis Infraestructuras SA 2.375% 19 - 27.09.27	100 000	EUR	94 683	97 412	0,38
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.375% 19 - 15.11.26	100 000	EUR	90 672	92 605	0,36
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.50% 20 - 14.01.27	100 000	EUR	90 259	92 243	0,36
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.375% 22 - 20.09.27	100 000	EUR	97 939	100 946	0,39
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.50% 17 - 10.02.27	100 000	EUR	97 590	100 111	0,39
Banco Santander SA 0.30% 19 - 04.10.26	100 000	EUR	91 109	92 905	0,36
Banco Santander SA 0.50% 20 - 04.02.27	100 000	EUR	89 226	91 754	0,36
Banco Santander SA 1.125% 20 - 23.06.27	100 000	EUR	90 615	93 325	0,36
Banco Santander SA 3.125% 17 - 19.01.27	100 000	EUR	96 704	99 159	0,39
Banco Santander SA FRN 23 - 18.10.27	100 000	EUR	100 106	102 453	0,40
CaixaBank SA FRN 22 - 21.01.28	100 000	EUR	89 827	92 245	0,36
CaixaBank SA FRN 21 - 26.05.28	100 000	EUR	88 182	91 162	0,35
Mapfre SA FRN 17 - 31.03.47	100 000	EUR	96 352	98 550	0,38
Merlin Properties Socimi SA 1.875% 16 - 02.11.26	100 000	EUR	94 115	96 263	0,37
Telefonica Emisiones SA 1.201% 20 - 21.08.27	100 000	EUR	91 407	93 332	0,36
Telefonica Emisiones SA 1.447% 18 - 22.01.27	100 000	EUR	93 617	95 388	0,37
			1 584 422	1 623 871	6,31
Suède					
Electrolux AB 4.125% 22 - 05.10.26	100 000	EUR	99 829	101 515	0,39
Fastighets AB Balder 1.125% 19 - 29.01.27	100 000	EUR	81 496	85 649	0,33
Sagax AB 1.125% 20 - 30.01.27	100 000	EUR	88 518	89 939	0,35
Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.75% 22 - 11.11.26	200 000	EUR	188 687	192 068	0,75
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.00% 22 - 09.11.26	100 000	EUR	99 667	101 748	0,40
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.125% 23 - 29.06.27	100 000	EUR	100 663	103 002	0,40
Svenska Handelsbanken AB 0.125% 21 - 03.11.26	100 000	EUR	90 116	91 900	0,36
Swedbank AB 2.10% 22 - 25.05.27	200 000	EUR	188 280	192 506	0,75
Swedbank AB FRN 22 - 23.08.32	100 000	EUR	93 950	97 757	0,38
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.125% 22 - 08.02.27	100 000	EUR	89 320	92 393	0,36
Telia Co. AB 3.00% 12 - 07.09.27	100 000	EUR	97 911	100 274	0,39
Volvo Treasury AB 2.00% 22 - 19.08.27	100 000	EUR	94 207	96 568	0,37
			1 312 644	1 345 319	5,23
Suisse					
UBS Group AG FRN 20 - 14.01.28	100 000	EUR	88 457	91 391	0,35
			88 457	91 391	0,35
Royaume-Uni					
Barclays PLC FRN 22 - 28.01.28	100 000	EUR	88 995	91 799	0,36
British Telecommunications PLC 1.50% 17 - 23.06.27	100 000	EUR	92 603	94 578	0,37
DS Smith PLC 4.375% 23 - 27.07.27	100 000	EUR	100 183	102 902	0,40
HSBC Holdings PLC 2.50% 16 - 15.03.27	100 000	EUR	95 309	98 083	0,38
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 10.03.28	100 000	EUR	100 909	103 716	0,40

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 4.125% 23 - 30.05.27	100 000	EUR	100 505	102 364	0,40
Lloyds Banking Group PLC 1.50% 17 - 12.09.27	100 000	EUR	91 392	94 483	0,37
Nationwide Building Society 2.00% 22 - 28.04.27	100 000	EUR	93 393	96 155	0,37
Nationwide Building Society 4.50% 23 - 01.11.26	100 000	EUR	102 286	103 144	0,40
NatWest Group PLC FRN 22 - 06.09.28	100 000	EUR	98 340	101 832	0,39
NatWest Markets PLC 1.375% 22 - 02.03.27	100 000	EUR	91 655	94 116	0,37
Santander UK Group Holdings PLC FRN 22 - 25.08.28	100 000	EUR	95 847	99 259	0,38
Standard Chartered PLC FRN 20 - 27.01.28	100 000	EUR	88 869	91 607	0,36
Thames Water Utilities Finance PLC 4.00% 23 - 18.04.27	100 000	EUR	95 236	96 782	0,38
Vodafone Group PLC 0.90% 19 - 24.11.26	100 000	EUR	92 718	94 806	0,37
			1 428 240	1 465 626	5,70
États-Unis					
3M Co. 1.50% 14 - 09.11.26	100 000	EUR	93 009	94 259	0,37
American International Group Inc. 1.875% 17 - 21.06.27	100 000	EUR	92 834	95 720	0,37
American Tower Corp. 0.45% 21 - 15.01.27	140 000	EUR	125 424	128 041	0,50
Apple Inc. 1.625% 14 - 10.11.26	100 000	EUR	95 399	97 128	0,38
Apple Inc. 2.00% 15 - 17.09.27	100 000	EUR	95 705	97 844	0,38
Bank of America Corp. FRN 21 - 24.08.28	100 000	EUR	87 629	90 120	0,35
Bank of America Corp. FRN 18 - 25.04.28	100 000	EUR	92 033	94 505	0,37
BMW US Capital LLC 1.00% 15 - 20.04.27	32 000	EUR	29 509	30 187	0,12
Booking Holdings Inc. 1.80% 15 - 03.03.27	100 000	EUR	94 229	96 272	0,37
Chubb INA Holdings Inc. 0.875% 19 - 15.06.27	100 000	EUR	91 157	93 647	0,36
Citigroup Inc. FRN 19 - 08.10.27	100 000	EUR	90 403	92 410	0,36
Citigroup Inc. FRN 22 - 22.09.28	100 000	EUR	98 573	101 463	0,39
Coca-Cola Co. 1.125% 15 - 09.03.27	100 000	EUR	92 735	94 352	0,37
Comcast Corp. 0.25% 20 - 20.05.27	100 000	EUR	89 128	91 677	0,36
Dover Corp. 1.25% 16 - 09.11.26	100 000	EUR	93 142	95 261	0,37
Dow Chemical Co. 0.50% 20 - 15.03.27	100 000	EUR	89 679	91 746	0,36
Equinix Inc. 0.25% 21 - 15.03.27	100 000	EUR	89 382	91 055	0,35
FedEx Corp. 1.625% 16 - 11.01.27	100 000	EUR	93 305	95 794	0,37
Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 19 - 21.05.27	100 000	EUR	91 507	94 645	0,37
Fiserv Inc. 1.125% 19 - 01.07.27	100 000	EUR	90 795	93 782	0,37
Ford Motor Credit Co. LLC 4.867% 23 - 03.08.27	100 000	EUR	99 750	102 815	0,40
General Motors Financial Co. Inc. 0.60% 21 - 20.05.27	100 000	EUR	88 840	91 386	0,36
International Business Machines Corp. 1.25% 19 - 29.01.27	100 000	EUR	93 214	95 005	0,37
International Business Machines Corp. 3.375% 23 - 06.02.27	100 000	EUR	99 226	101 202	0,39
JPMorgan Chase & Co. FRN 20 - 24.02.28	100 000	EUR	88 824	91 104	0,35
JPMorgan Chase & Co. 1.50% 16 - 29.10.26	100 000	EUR	94 059	95 813	0,37
JPMorgan Chase & Co. FRN 17 - 18.05.28	129 000	EUR	118 718	121 855	0,47
McDonald's Corp. 1.875% 15 - 26.05.27	100 000	EUR	94 203	96 120	0,37

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
McKesson Corp. 1.625% 18 - 30.10.26	100 000	EUR	94 814	96 291	0,37
Merck & Co. Inc. 1.875% 14 - 15.10.26	100 000	EUR	95 405	97 299	0,38
Mondelez International Inc. 1.625% 15 - 08.03.27	100 000	EUR	93 529	95 530	0,37
Morgan Stanley FRN 21 - 29.10.27	113 000	EUR	101 234	103 763	0,40
Morgan Stanley 1.375% 16 - 27.10.26	200 000	EUR	186 374	189 974	0,74
Morgan Stanley 1.875% 17 - 27.04.27	129 000	EUR	120 366	123 088	0,48
Netflix Inc. 3.625% 17 - 15.05.27	100 000	EUR	99 386	101 183	0,39
New York Life Global Funding 0.25% 20 - 23.01.27	100 000	EUR	90 463	92 542	0,36
Procter & Gamble Co. 4.875% 07 - 11.05.27	65 000	EUR	68 261	69 227	0,27
Prologis Euro Finance LLC 0.25% 19 - 10.09.27	100 000	EUR	87 829	89 989	0,35
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.75% 20 - 15.04.27	100 000	EUR	94 259	96 448	0,38
Verizon Communications Inc. 0.875% 19 - 08.04.27	100 000	EUR	91 472	93 468	0,36
Verizon Communications Inc. 1.375% 17 - 27.10.26	100 000	EUR	93 898	95 674	0,37
Wells Fargo & Co. 1.00% 16 - 02.02.27	129 000	EUR	116 730	119 828	0,47
Wells Fargo & Co. 1.375% 16 - 26.10.26	229 000	EUR	211 879	216 215	0,84
Wells Fargo & Co. 1.50% 17 - 24.05.27	100 000	EUR	91 247	93 867	0,37
			4 329 557	4 429 594	17,22
Total - Obligations			24 786 848	25 389 832	98,68
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			24 786 848	25 389 832	98,68
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			24 786 848	25 389 832	98,68
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				25 665 005	99,75

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
CIMIC Finance Ltd. 1.50% 21 - 28.05.29	100 000	EUR	81 068	86 809	0,37
Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 1.45% 19 - 28.03.29	100 000	EUR	85 416	88 099	0,37
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 1.45% 19 - 16.05.29	100 000	EUR	86 981	91 092	0,39
			253 465	266 000	1,13
Autriche					
Erste Group Bank AG 0.25% 21 - 14.09.29	100 000	EUR	80 456	84 304	0,36
Erste Group Bank AG FRN 23 - 30.05.30	100 000	EUR	102 590	103 786	0,44
Wienerberger AG 4.875% 23 - 04.10.28	100 000	EUR	103 922	106 001	0,45
			286 968	294 091	1,25
Belgique					
Elia Transmission Belgium SA 3.00% 14 - 07.04.29	100 000	EUR	95 796	99 061	0,42
Groupe Bruxelles Lambert NV 3.125% 22 - 06.09.29	100 000	EUR	96 930	100 293	0,42
KBC Group NV FRN 23 - 28.11.29	100 000	EUR	101 304	102 746	0,44
KBC Group NV FRN 23 - 19.04.30	100 000	EUR	99 547	103 801	0,44
			393 577	405 901	1,72
Canada					
Bank of Nova Scotia 0.25% 21 - 01.11.28	100 000	EUR	85 690	86 803	0,37
Royal Bank of Canada 2.125% 22 - 26.04.29	100 000	EUR	90 339	94 232	0,40
			176 029	181 035	0,77
Danemark					
Danske Bank A/S FRN 23 - 21.06.30	100 000	EUR	100 374	105 443	0,45
Jyske Bank A/S FRN 23 - 10.11.29	100 000	EUR	102 666	104 059	0,44
			203 040	209 502	0,89
Finlande					
Balder Finland OYJ 1.00% 21 - 20.01.29	100 000	EUR	69 531	76 338	0,32
Castellum Helsinki Finance Holdings Abp 0.875% 21 - 17.09.29	100 000	EUR	72 744	77 133	0,33
Neste OYJ 3.875% 23 - 16.03.29	100 000	EUR	102 015	103 071	0,44
Nordea Bank Abp 0.50% 21 - 02.11.28	100 000	EUR	86 756	87 838	0,37
Nordea Bank Abp 2.50% 22 - 23.05.29	100 000	EUR	92 227	96 173	0,41
Nordea Bank Abp FRN 23 - 23.02.34	120 000	EUR	122 885	124 704	0,53
OP Corporate Bank PLC 0.375% 21 - 08.12.28	100 000	EUR	84 038	86 450	0,37
Sampo OYJ FRN 19 - 23.05.49	100 000	EUR	92 775	94 122	0,40
			722 971	745 829	3,17
France					
Accor SA 2.375% 21 - 29.11.28	100 000	EUR	91 715	95 321	0,41
Alstom SA Zero Coupon 21 - 11.01.29	100 000	EUR	78 475	82 370	0,35
APRR SA 1.875% 22 - 03.01.29	100 000	EUR	91 611	95 256	0,40
AXA SA FRN 18 - 28.05.49	100 000	EUR	91 052	95 894	0,41
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 21 - 03.11.28	100 000	EUR	83 742	87 470	0,37
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19 - 15.03.29	100 000	EUR	88 764	91 496	0,39
Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.875% 19 - 18.06.29	200 000	EUR	173 119	182 456	0,78
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.125% 23 - 13.03.29	100 000	EUR	99 879	103 804	0,44

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
BNP Paribas SA FRN 21 - 19.01.30	100 000	EUR	81 944	85 762	0,36
BNP Paribas SA FRN 22 - 11.07.30	200 000	EUR	165 528	172 380	0,73
BNP Paribas SA 1.375% 19 - 28.05.29	100 000	EUR	85 807	89 932	0,38
BNP Paribas SA 3.625% 22 - 01.09.29	100 000	EUR	96 037	100 366	0,43
BPCE SA 1.00% 16 - 05.10.28	100 000	EUR	88 042	91 385	0,39
BPCE SA FRN 23 - 02.03.30	100 000	EUR	100 576	104 500	0,44
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole					
Groupama 2.125% 19 - 16.09.29	100 000	EUR	86 759	91 465	0,39
Capgemini SE 2.00% 20 - 15.04.29	100 000	EUR	92 560	95 693	0,41
Carmila SA 1.625% 21 - 01.04.29	100 000	EUR	84 807	86 376	0,37
Carrefour SA 4.125% 22 - 12.10.28	100 000	EUR	101 155	104 050	0,44
Cie de Saint-Gobain 3.50% 23 - 18.01.29	100 000	EUR	98 684	102 125	0,43
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA Zero					
Coupon 20 - 02.11.28	100 000	EUR	84 618	88 203	0,37
Credit Agricole SA 1.00% 19 - 03.07.29	200 000	EUR	173 979	178 242	0,76
Credit Agricole SA 1.125% 22 - 24.02.29	100 000	EUR	88 578	91 085	0,39
Credit Agricole SA 1.75% 19 - 05.03.29	200 000	EUR	178 810	184 714	0,78
Credit Agricole SA 2.00% 19 - 25.03.29	200 000	EUR	176 343	185 438	0,79
Credit Agricole SA 2.50% 22 - 29.08.29	100 000	EUR	92 624	96 405	0,41
Credit Mutuel Arkea SA 0.375% 19 - 03.10.28	100 000	EUR	84 209	87 515	0,37
Credit Mutuel Arkea SA 3.50% 17 - 09.02.29	100 000	EUR	94 497	98 813	0,42
Danone SA 0.395% 20 - 10.06.29	100 000	EUR	84 429	87 881	0,37
Danone SA 1.208% 16 - 03.11.28	100 000	EUR	89 553	93 173	0,40
Dassault Systemes SE 0.375% 19 - 16.09.29	100 000	EUR	84 132	88 099	0,37
Edenred 1.375% 20 - 18.06.29	100 000	EUR	88 657	91 968	0,39
ELO SACA 4.875% 22 - 08.12.28	100 000	EUR	96 159	99 014	0,42
ELO SACA 6.00% 23 - 22.03.29	100 000	EUR	97 980	101 606	0,43
JCDecaux SE 5.00% 23 - 11.01.29	100 000	EUR	103 847	105 123	0,45
Klepierre SA 2.00% 20 - 12.05.29	100 000	EUR	89 699	93 817	0,40
Legrand SA 3.50% 23 - 29.05.29	100 000	EUR	100 278	103 324	0,44
Orange SA 0.125% 20 - 16.09.29	100 000	EUR	82 828	86 346	0,37
Orange SA FRN 21 - 31.12.99	100 000	EUR	84 229	85 255	0,36
Orange SA FRN 20 - 31.12.99	100 000	EUR	84 332	88 677	0,38
Orange SA 2.00% 19 - 15.01.29	100 000	EUR	93 505	96 074	0,41
SANEF SA 0.95% 16 - 19.10.28	100 000	EUR	86 613	90 212	0,38
Sanofi 0.875% 19 - 21.03.29	100 000	EUR	90 212	91 426	0,39
Sanofi 1.25% 22 - 06.04.29	100 000	EUR	89 298	93 068	0,40
Schneider Electric SE 0.25% 20 - 11.03.29	100 000	EUR	84 909	88 189	0,37
Societe Generale SA 0.875% 19 - 24.09.29	100 000	EUR	84 368	85 541	0,36
Societe Generale SA 1.75% 19 - 22.03.29	100 000	EUR	87 085	90 877	0,39
Societe Generale SA 2.625% 22 - 30.05.29	100 000	EUR	93 092	97 245	0,41
Societe Generale SA 4.125% 23 - 21.11.28	100 000	EUR	101 321	103 571	0,44
Sodexo SA 1.00% 20 - 27.04.29	200 000	EUR	174 621	181 680	0,77
Teleperformance 3.75% 22 - 24.06.29	100 000	EUR	92 777	99 657	0,42
Teleperformance SE 5.25% 23 - 22.11.28	100 000	EUR	102 761	104 703	0,44
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.50% 17 - 29.05.29	100 000	EUR	85 933	90 826	0,39

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN 23 - 31.12.99	100 000	EUR	88 919	99 858	0,42
Vivendi SE 1.125% 19 - 11.12.28	100 000	EUR	88 719	94 802	0,40
			5 384 170	5 600 528	23,78
Allemagne					
adidas AG Zero Coupon 20 - 05.10.28	100 000	EUR	84 912	88 267	0,38
Allianz SE FRN 19 - 25.09.49	200 000	EUR	164 105	172 570	0,73
Amphenol Technologies Holdings GmbH 2.00% 18 - 08.10.28	100 000	EUR	95 398	96 419	0,41
Commerzbank AG FRN 23 - 18.01.30	100 000	EUR	98 997	104 649	0,45
Deutsche Bank AG FRN 22 - 05.09.30	100 000	EUR	97 510	103 288	0,44
Deutsche Boerse AG 3.75% 23 - 28.09.29	100 000	EUR	100 440	104 002	0,44
Deutsche Post AG 0.75% 20 - 20.05.29	100 000	EUR	87 788	91 382	0,39
Deutsche Post AG 1.625% 18 - 05.12.28	100 000	EUR	91 894	95 219	0,40
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main 0.40% 21 - 17.11.28	100 000	EUR	84 948	85 282	0,36
Infineon Technologies AG 1.625% 20 - 24.06.29	100 000	EUR	89 720	92 669	0,39
LEG Immobilien SE 0.875% 22 - 17.01.29	100 000	EUR	83 659	87 396	0,37
Mercedes-Benz Group AG 1.50% 17 - 03.07.29	100 000	EUR	89 071	93 547	0,40
Merck KGaA FRN 19 - 25.06.79	100 000	EUR	88 551	91 782	0,39
Muenchener Hypothekenbank eG 0.375% 21 - 09.03.29	100 000	EUR	84 360	84 851	0,36
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 18 - 26.05.49	100 000	EUR	92 035	96 837	0,41
SAP SE 0.375% 20 - 18.05.29	100 000	EUR	85 622	88 959	0,38
Vier Gas Transport GmbH 0.125% 19 - 10.09.29	100 000	EUR	83 869	85 491	0,36
			1 602 879	1 662 610	7,06
Irlande					
CRH Finance Dac 1.375% 16 - 18.10.28	100 000	EUR	89 256	92 496	0,39
Kerry Group Financial Services Unltd Co. 0.625% 19 - 20.09.29	100 000	EUR	84 020	88 138	0,38
Linde PLC 3.375% 23 - 12.06.29	100 000	EUR	98 669	102 737	0,44
Smurfit Kappa Treasury ULC 0.50% 21 - 22.09.29	100 000	EUR	84 076	85 528	0,36
Vodafone International Financing Dac 3.25% 22 - 02.03.29	100 000	EUR	97 840	101 252	0,43
			453 861	470 151	2,00
Italie					
Aeroporti di Roma SpA 1.625% 20 - 02.02.29	100 000	EUR	90 569	91 772	0,39
Assicurazioni Generali SpA 3.875% 19 - 29.01.29	120 000	EUR	118 723	121 286	0,51
Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 19 - 04.07.29	100 000	EUR	86 264	91 101	0,39
Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.375% 21 - 23.06.29	150 000	EUR	125 265	129 510	0,55
Terna - Rete Elettrica Nazionale 3.625% 23 - 21.04.29	100 000	EUR	98 112	102 064	0,43
			518 933	535 733	2,27
Japon					
Mizuho Financial Group Inc. 0.402% 19 - 06.09.29	100 000	EUR	80 510	84 172	0,36
NTT Finance Corp. 0.399% 21 - 13.12.28	100 000	EUR	85 695	88 826	0,37
			166 205	172 998	0,73

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Liechtenstein					
Swiss Life Finance I Ltd. 3.25% 22 - 31.08.29	100 000	EUR	95 280	100 211	0,42
			95 280	100 211	0,42
Luxembourg					
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 3.553% 23 - 13.09.29	100 000	EUR	98 116	102 081	0,43
CNH Industrial Finance Europe SA 1.625% 19 - 03.07.29	100 000	EUR	87 790	91 004	0,39
Eurofins Scientific SE 4.00% 22 - 06.07.29	100 000	EUR	99 946	101 309	0,43
Holcim Finance Luxembourg SA 1.75% 17 - 29.08.29	100 000	EUR	88 262	92 218	0,39
Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 20 - 15.10.28	100 000	EUR	87 855	88 954	0,38
Medtronic Global Holdings SCA 3.00% 22 - 15.10.28	100 000	EUR	97 130	100 265	0,43
Nestle Finance International Ltd. 0.25% 21 - 14.06.29	100 000	EUR	85 333	88 433	0,37
Tyco Electronics Group SA Zero Coupon 21 - 16.02.29	100 000	EUR	85 663	86 416	0,37
			730 095	750 680	3,19
Pays-Bas					
ABN AMRO Bank NV 0.50% 21 - 23.09.29	200 000	EUR	163 013	169 942	0,72
AGCO International Holdings BV 0.80% 21 - 06.10.28	100 000	EUR	84 725	87 574	0,37
ASML Holdings NV 0.625% 20 - 07.05.29	100 000	EUR	86 844	89 488	0,38
ASR Nederland NV FRN 19 - 02.05.49	100 000	EUR	88 904	92 739	0,39
BMW Finance NV 1.50% 19 - 06.02.29	100 000	EUR	90 404	93 518	0,40
BMW Finance NV 3.875% 23 - 04.10.28	100 000	EUR	100 933	104 562	0,44
CTP NV 1.25% 21 - 21.06.29	100 000	EUR	80 870	82 586	0,35
Essity Capital BV 0.25% 21 - 15.09.29	100 000	EUR	85 392	86 963	0,37
Euronext NV 1.125% 19 - 12.06.29	100 000	EUR	87 638	91 307	0,39
H&M Finance BV 0.25% 21 - 25.08.29	150 000	EUR	121 570	125 331	0,53
ING Groep NV FRN 21 - 01.02.30	100 000	EUR	81 815	84 329	0,36
JAB Holdings BV 2.50% 18 - 25.06.29	100 000	EUR	96 119	96 124	0,41
JDE Peet's NV 0.50% 21 - 16.01.29	100 000	EUR	85 336	86 629	0,37
Madrilena Red de Gas Finance BV 2.25% 17 - 11.04.29	100 000	EUR	86 448	89 405	0,38
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.375% 20 - 22.09.29	200 000	EUR	166 176	172 556	0,73
Prosus NV Zero Coupon 21 - 13.07.29	140 000	EUR	107 963	113 739	0,48
Roche Finance Europe BV 3.204% 23 - 27.08.29	100 000	EUR	99 191	102 639	0,44
Sagax Euro Mtn NL BV 1.00% 21 - 17.05.29	100 000	EUR	77 897	81 752	0,35
Sartorius Finance BV 4.375% 23 - 14.09.29	100 000	EUR	100 609	103 615	0,44
Siemens Energy Finance BV 4.25% 23 - 05.04.29	100 000	EUR	95 528	97 379	0,41
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.125% 19 - 05.09.29	100 000	EUR	87 758	89 196	0,38
Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.25% 20 - 20.02.29	100 000	EUR	85 490	88 318	0,38
Stellantis NV 0.75% 21 - 18.01.29	200 000	EUR	171 639	177 716	0,75
Stellantis NV 1.125% 19 - 18.09.29	100 000	EUR	88 594	89 779	0,38
Unilever Finance Netherlands BV 1.375% 17 - 31.07.29	100 000	EUR	89 442	92 794	0,39

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Unilever Finance Netherlands BV 1.75% 22 - 16.11.28	100 000	EUR	93 223	95 546	0,41
Volkswagen International Finance NV FRN 20 - 31.12.99	200 000	EUR	184 042	183 240	0,78
Volkswagen International Finance NV 4.25% 23 - 29.03.29	200 000	EUR	208 928	207 910	0,88
Vonovia Finance BV 0.50% 19 - 14.09.29	100 000	EUR	79 770	82 371	0,35
			3 076 261	3 159 047	13,41
Nouvelle-Zélande					
ANZ New Zealand Int'l Ltd. 0.375% 19 - 17.09.29	200 000	EUR	166 590	171 398	0,73
ASB Bank Ltd. 0.50% 19 - 24.09.29	200 000	EUR	167 111	172 374	0,73
Chorus Ltd. 3.625% 22 - 07.09.29	120 000	EUR	120 363	121 970	0,52
			454 064	465 742	1,98
Norvège					
Norsk Hydro ASA 2.00% 19 - 11.04.29	100 000	EUR	88 418	92 210	0,39
			88 418	92 210	0,39
Espagne					
Abertis Infraestructuras SA 1.625% 19 - 15.07.29	100 000	EUR	87 371	90 718	0,38
Abertis Infraestructuras SA 2.25% 20 - 29.03.29	100 000	EUR	90 519	93 894	0,40
Abertis Infraestructuras SA 4.125% 23 - 07.08.29	100 000	EUR	97 799	102 714	0,44
Bankinter SA FRN 23 - 03.05.30	100 000	EUR	99 242	103 715	0,44
CaixaBank SA 3.75% 22 - 07.09.29	100 000	EUR	101 259	102 561	0,43
CaixaBank SA FRN 23 - 30.05.34	200 000	EUR	200 730	211 564	0,90
Inmobiliaria Colonial Socimi SA 0.75% 21 - 22.06.29	100 000	EUR	83 147	86 487	0,37
Merlin Properties Socimi SA 2.375% 17 - 18.09.29	100 000	EUR	90 153	94 717	0,40
Telefonica Emisiones SA 1.788% 19 - 12.03.29	100 000	EUR	91 079	94 153	0,40
Telefonica Emisiones SA 2.318% 17 - 17.10.28	100 000	EUR	93 733	96 385	0,41
			1 035 032	1 076 908	4,57
Suède					
Molnlycke Holdings AB 0.875% 19 - 05.09.29	100 000	EUR	82 458	86 109	0,37
Sandvik AB 0.375% 21 - 25.11.28	100 000	EUR	84 856	87 986	0,37
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.375% 23 - 06.11.28	100 000	EUR	100 614	103 742	0,44
Svenska Handelsbanken AB 1.375% 22 - 23.02.29	150 000	EUR	135 417	136 991	0,58
Svenska Handelsbanken AB 2.625% 22 - 05.09.29	100 000	EUR	94 546	97 675	0,41
Svenska Handelsbanken AB FRN 23 - 16.08.34	100 000	EUR	99 201	104 831	0,45
Swedbank AB 4.125% 23 - 13.11.28	100 000	EUR	102 335	103 601	0,44
			699 427	720 935	3,06
Suisse					
UBS Group AG 0.65% 19 - 10.09.29	200 000	EUR	162 470	170 214	0,72
			162 470	170 214	0,72
Royaume-Uni					
3i Group PLC 4.875% 23 - 14.06.29	100 000	EUR	100 002	104 513	0,45
AstraZeneca PLC 0.375% 21 - 03.06.29	100 000	EUR	84 483	87 985	0,37
Barclays PLC FRN 23 - 08.08.30	100 000	EUR	99 096	104 240	0,44
British Telecommunications PLC 1.125% 19 - 12.09.29	100 000	EUR	85 780	89 733	0,38
Cadent Finance PLC 4.25% 23 - 05.07.29	100 000	EUR	99 897	104 399	0,44

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0.20% 20 - 02.12.28	100 000	EUR	83 965	87 262	0,37
GlaxoSmithKline Capital PLC 1.375% 17 - 12.09.29	100 000	EUR	89 256	92 650	0,39
Lloyds Banking Group PLC FRN 22 - 24.08.30	100 000	EUR	92 350	97 329	0,41
Nationwide Building Society 3.25% 22 - 05.09.29	100 000	EUR	94 652	99 831	0,43
NatWest Group PLC FRN 21 - 26.02.30	100 000	EUR	84 726	86 115	0,37
NatWest Group PLC FRN 23 - 28.02.34	100 000	EUR	98 728	105 209	0,45
Standard Chartered PLC FRN 21 - 17.11.29	100 000	EUR	83 918	87 014	0,37
			1 096 853	1 146 280	4,87
États-Unis					
AbbVie Inc. 2.125% 16 - 17.11.28	100 000	EUR	92 956	96 366	0,41
AbbVie Inc. 2.625% 20 - 15.11.28	100 000	EUR	97 205	98 341	0,42
American Tower Corp. 0.875% 21 - 21.05.29	100 000	EUR	82 696	87 173	0,37
Apple Inc. 1.375% 17 - 24.05.29	100 000	EUR	90 698	93 956	0,40
AT&T Inc. 2.35% 18 - 05.09.29	100 000	EUR	91 526	95 831	0,41
Bank of America Corp. FRN 19 - 09.05.30	100 000	EUR	85 538	89 410	0,38
Baxter International Inc. 1.30% 19 - 15.05.29	100 000	EUR	88 546	89 756	0,38
Booking Holdings Inc. 3.625% 23 - 12.11.28	100 000	EUR	99 290	102 748	0,44
Capital One Financial Corp. 1.65% 19 - 12.06.29	100 000	EUR	83 543	88 022	0,37
Citigroup Inc. 1.25% 19 - 10.04.29	250 000	EUR	217 155	224 765	0,95
Citigroup Inc. 1.50% 16 - 26.10.28	100 000	EUR	89 085	92 090	0,39
Coca-Cola Co. 0.125% 20 - 15.03.29	100 000	EUR	84 370	87 197	0,37
Coca-Cola Co. 0.125% 21 - 09.03.29	100 000	EUR	86 209	87 112	0,37
Comcast Corp. 0.25% 21 - 14.09.29	100 000	EUR	82 191	86 456	0,37
FedEx Corp. 0.45% 21 - 04.05.29	100 000	EUR	83 975	86 916	0,37
Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 19 - 03.12.28	100 000	EUR	87 096	90 232	0,38
Ford Motor Credit Co. LLC 5.125% 23 - 20.02.29	100 000	EUR	102 843	104 698	0,44
General Electric Co. 1.50% 17 - 17.05.29	100 000	EUR	88 617	92 574	0,39
General Mills Inc. 3.907% 23 - 13.04.29	100 000	EUR	100 450	103 176	0,44
General Motors Financial Co. Inc. 4.30% 23 - 15.02.29	100 000	EUR	101 064	103 025	0,44
Goldman Sachs Group Inc. 0.875% 21 - 09.05.29	100 000	EUR	84 705	86 941	0,37
Goldman Sachs Group Inc. 1.25% 22 - 07.02.29	100 000	EUR	86 030	89 477	0,38
Goldman Sachs Group Inc. 2.00% 18 - 01.11.28	100 000	EUR	92 616	94 540	0,40
Goldman Sachs Group Inc. 4.00% 22 - 21.09.29	100 000	EUR	99 191	103 190	0,44
International Business Machines Corp. 1.50% 17 - 23.05.29	100 000	EUR	89 497	93 106	0,40
Johnson & Johnson 1.15% 16 - 20.11.28	100 000	EUR	91 603	94 101	0,40
JPMorgan Chase & Co. FRN 22 - 23.03.30	350 000	EUR	320 530	326 011	1,38
Kellanova 0.50% 21 - 20.05.29	100 000	EUR	84 073	86 617	0,37
Mastercard Inc. 1.00% 22 - 22.02.29	100 000	EUR	89 165	91 856	0,39
McDonald's Corp. 0.25% 21 - 04.10.28	100 000	EUR	85 631	88 172	0,37
McDonald's Corp. 2.375% 22 - 31.05.29	100 000	EUR	93 197	96 953	0,41
Metropolitan Life Global Funding I 0.50% 21 - 25.05.29	100 000	EUR	83 480	87 004	0,37
Microsoft Corp. 3.125% 13 - 06.12.28	100 000	EUR	100 465	103 004	0,44
Morgan Stanley FRN 20 - 26.10.29	100 000	EUR	83 013	86 332	0,37

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Nasdaq Inc. 1.75% 19 - 28.03.29	100 000	EUR	89 417	92 797	0,39
Netflix Inc. 4.625% 18 - 15.05.29	100 000	EUR	105 525	106 857	0,45
PPG Industries Inc. 2.75% 22 - 01.06.29	100 000	EUR	94 731	97 694	0,41
Procter & Gamble Co. 1.20% 18 - 30.10.28	100 000	EUR	90 616	93 371	0,40
Prologis Euro Finance LLC 1.00% 22 - 08.02.29	200 000	EUR	172 934	177 630	0,75
Stryker Corp. 0.75% 19 - 01.03.29	100 000	EUR	85 891	88 922	0,38
Thermo Fisher Scientific Inc. 1.95% 17 - 24.07.29	100 000	EUR	91 176	94 900	0,40
Verizon Communications Inc. 0.375% 21 - 22.03.29	200 000	EUR	168 068	173 860	0,74
Visa Inc. 2.00% 22 - 15.06.29	100 000	EUR	92 340	96 155	0,41
Walmart Inc. 4.875% 09 - 21.09.29	100 000	EUR	107 462	111 276	0,47
Wells Fargo & Co. FRN 20 - 04.05.30	100 000	EUR	87 348	90 916	0,39
Westlake Corp. 1.625% 19 - 17.07.29	100 000	EUR	84 745	89 759	0,38
			4 688 502	4 841 285	20,55
Total - Obligations			22 288 500	23 067 890	97,93
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			22 288 500	23 067 890	97,93
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			22 288 500	23 067 890	97,93
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				23 315 068	98,98

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
National Australia Bank Ltd. 1.125% 19 - 20.05.31	100 000	EUR	88 204	89 594	0,38
Telstra Group Ltd. 3.75% 23 - 04.05.31	100 000	EUR	102 879	104 843	0,44
			191 083	194 437	0,82
Autriche					
Erste Group Bank AG 0.25% 21 - 27.01.31	100 000	EUR	80 102	81 516	0,34
			80 102	81 516	0,34
Belgique					
Aedifica SA 0.75% 21 - 09.09.31	100 000	EUR	77 647	79 547	0,34
Cofinimmo SA 0.875% 20 - 02.12.30	100 000	EUR	74 845	81 176	0,34
Groupe Bruxelles Lambert NV 0.125% 21 - 28.01.31	100 000	EUR	79 164	80 508	0,34
KBC Group NV 0.75% 21 - 31.05.31	100 000	EUR	80 826	83 848	0,35
			312 482	325 079	1,37
Canada					
Royal Bank of Canada 4.375% 23 - 02.10.30	100 000	EUR	102 003	105 119	0,44
			102 003	105 119	0,44
Danemark					
TDC Net A/S 6.50% 23 - 01.06.31	100 000	EUR	102 282	105 941	0,45
Vestas Wind Systems A/S 4.125% 23 - 15.06.31	100 000	EUR	99 742	103 200	0,43
			202 024	209 141	0,88
Finlande					
Balder Finland OYJ 2.00% 22 - 18.01.31	120 000	EUR	79 299	87 929	0,37
Metso OYJ 4.375% 23 - 22.11.30	100 000	EUR	101 443	103 337	0,44
Neste OYJ 3.875% 23 - 21.05.31	100 000	EUR	102 055	103 739	0,44
Nokia OYJ 4.375% 23 - 21.08.31	100 000	EUR	98 820	100 533	0,42
Nordea Bank Abp 0.50% 21 - 19.03.31	100 000	EUR	82 174	83 447	0,35
Stora Enso OYJ 0.625% 20 - 02.12.30	100 000	EUR	77 328	81 407	0,34
			541 119	560 392	2,36
France					
Air Liquide Finance SA 0.375% 21 - 27.05.31	100 000	EUR	79 711	84 382	0,36
Arkema SA 3.50% 23 - 23.01.31	100 000	EUR	98 480	100 206	0,42
Autoroutes du Sud de la France SA 1.375% 19 - 21.02.31	200 000	EUR	173 369	179 714	0,76
AXA SA 3.75% 22 - 12.10.30	100 000	EUR	102 069	105 460	0,44
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.625% 20 - 21.02.31	200 000	EUR	158 358	163 696	0,69
BNP Paribas SA 1.625% 19 - 02.07.31	200 000	EUR	162 078	170 800	0,72
BNP Paribas SA FRN 23 - 26.09.32	300 000	EUR	306 644	314 226	1,32
Bouygues SA 3.875% 23 - 17.07.31	100 000	EUR	101 288	104 297	0,44
BPCE SA 0.25% 21 - 14.01.31	200 000	EUR	156 739	161 020	0,68
BPCE SA 0.75% 21 - 03.03.31	200 000	EUR	159 874	165 950	0,70
Carrefour SA 3.75% 23 - 10.10.30	100 000	EUR	100 239	102 077	0,43
Cie de Saint-Gobain 1.875% 19 - 15.03.31	200 000	EUR	178 407	184 584	0,78
Cie de Saint-Gobain SA 3.875% 23 - 29.11.30	200 000	EUR	203 741	206 674	0,87
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 1.00% 20 - 19.05.31	200 000	EUR	170 108	173 200	0,73
Covivio 1.125% 19 - 17.09.31	100 000	EUR	80 558	82 283	0,35
Credit Agricole SA 3.875% 23 - 20.04.31	300 000	EUR	302 420	310 050	1,31
Credit Mutuel Arkea SA 3.375% 19 - 11.03.31	100 000	EUR	90 855	96 316	0,41

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Credit Mutuel Arkea SA 4.125% 23 - 02.04.31	100 000	EUR	103 116	104 782	0,44
Danone SA 0.52% 21 - 09.11.30	200 000	EUR	164 588	169 758	0,72
Danone SA 3.47% 23 - 22.05.31	100 000	EUR	100 597	102 671	0,43
Edenred 3.625% 23 - 13.06.31	100 000	EUR	98 687	101 734	0,43
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.475% 22 - 18.01.31	200 000	EUR	165 908	171 446	0,72
ICADE 0.625% 21 - 18.01.31	100 000	EUR	76 999	78 820	0,33
Kering SA 3.625% 23 - 05.09.31	200 000	EUR	200 593	206 828	0,87
Klepierre SA 1.25% 16 - 29.09.31	200 000	EUR	161 271	169 052	0,71
Societe Generale SA FRN 23 - 21.11.31	200 000	EUR	205 876	209 164	0,88
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.875% 18 - 15.01.31	200 000	EUR	170 810	179 616	0,76
Unibail-Rodamco-Westfield SE 4.125% 23 - 11.12.30	100 000	EUR	103 842	103 187	0,43
Wendel SE 1.00% 21 - 01.06.31	100 000	EUR	81 404	83 810	0,35
			4 258 629	4 385 803	18,48
Allemagne					
Berlin Hyp AG 0.375% 21 - 21.04.31	100 000	EUR	77 488	78 913	0,33
Deutsche Bank AG FRN 21 - 17.02.32	200 000	EUR	155 937	164 282	0,69
Deutsche Boerse AG 0.125% 21 - 22.02.31	100 000	EUR	81 403	83 041	0,35
Deutsche Telekom AG 1.75% 19 - 25.03.31	210 000	EUR	192 024	197 293	0,83
Deutsche Wohnen SE 0.50% 21 - 07.04.31	100 000	EUR	80 191	82 256	0,35
Eurogrid GmbH 3.279% 22 - 05.09.31	100 000	EUR	96 751	99 420	0,42
Fresenius SE & Co. KGaA 5.125% 23 - 05.10.30	50 000	EUR	52 841	53 837	0,23
Hannover Rueck SE FRN 20 - 08.10.40	100 000	EUR	84 554	86 123	0,36
LEG Immobilien SE 0.75% 21 - 30.06.31	100 000	EUR	77 349	79 299	0,33
Mercedes-Benz Group AG 2.00% 19 - 27.02.31	20 000	EUR	18 533	19 123	0,08
Merck Financial Services GmbH 0.875% 19 - 05.07.31	100 000	EUR	83 569	86 117	0,36
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 20 - 26.05.41	200 000	EUR	159 735	165 770	0,70
SAP SE 1.625% 18 - 10.03.31	300 000	EUR	272 296	279 861	1,18
Volkswagen Leasing GmbH 4.75% 23 - 25.09.31	100 000	EUR	107 399	106 664	0,45
Vonovia SE 0.625% 21 - 24.03.31	100 000	EUR	75 738	78 802	0,33
Vonovia SE 5.00% 22 - 23.11.30	100 000	EUR	103 291	105 705	0,45
			1 719 099	1 766 506	7,44
Irlande					
AIB Group PLC FRN 23 - 23.10.31	100 000	EUR	103 993	108 020	0,46
CRH SMW Finance DAC 4.00% 23 - 11.07.31	200 000	EUR	201 084	207 712	0,88
DXC Capital Funding Dac 0.95% 21 - 15.09.31	120 000	EUR	86 647	96 077	0,40
Linde PLC 1.375% 22 - 31.03.31	100 000	EUR	88 419	90 155	0,38
			480 143	501 964	2,12
Italie					
Aeroporti di Roma SpA 1.75% 21 - 30.07.31	100 000	EUR	84 642	86 243	0,36
Assicurazioni Generali SpA 2.124% 19 - 01.10.30	100 000	EUR	82 536	88 096	0,37
Assicurazioni Generali SpA 2.429% 20 - 14.07.31	100 000	EUR	85 275	87 329	0,37
Intesa Sanpaolo SpA 5.125% 23 - 29.08.31	420 000	EUR	434 132	448 199	1,89
Snam SpA 0.625% 21 - 30.06.31	100 000	EUR	80 240	82 041	0,35
UniCredit SpA 0.85% 21 - 19.01.31	200 000	EUR	158 922	164 892	0,69
			925 747	956 800	4,03

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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					
Mizuho Financial Group Inc. 0.693% 20 - 07.10.30	200 000	EUR	160 887	166 552	0,70
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.00% 18 - 21.11.30	300 000	EUR	287 503	295 893	1,25
			448 390	462 445	1,95
Jersey					
Heathrow Funding Ltd. 1.125% 21 - 08.10.30	120 000	EUR	100 632	102 653	0,43
			100 632	102 653	0,43
Liechtenstein					
Swiss Life Finance I Ltd. 0.50% 21 - 15.09.31	100 000	EUR	79 864	81 092	0,34
			79 864	81 092	0,34
Luxembourg					
CPI Property Group SA 1.50% 21 - 27.01.31	200 000	EUR	104 812	104 146	0,44
DH Europe Finance II Sarl 0.75% 19 - 18.09.31	300 000	EUR	247 341	252 855	1,06
Eurofins Scientific SE 0.875% 21 - 19.05.31	100 000	EUR	79 036	81 321	0,34
Helvetia Europe SA FRN 20 - 30.09.41	100 000	EUR	81 440	86 655	0,36
Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 20 - 23.04.31	100 000	EUR	78 332	81 419	0,34
Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 19 - 02.07.31	200 000	EUR	169 397	172 884	0,73
Medtronic Global Holdings SCA 1.625% 19 - 07.03.31	180 000	EUR	157 777	163 029	0,69
Nestle Finance International Ltd. 1.25% 22 - 29.03.31	70 000	EUR	61 535	62 959	0,27
Nestle Finance International Ltd. 3.25% 22 - 15.01.31	120 000	EUR	121 911	123 493	0,52
Segro Capital Sarl 0.50% 21 - 22.09.31	120 000	EUR	91 124	94 276	0,40
			1 192 705	1 223 037	5,15
Pays-Bas					
ABB Finance BV 3.375% 23 - 16.01.31	100 000	EUR	97 522	102 554	0,43
Adecco International Financial Services BV 0.50% 21 - 21.09.31	100 000	EUR	77 571	83 065	0,35
Allianz Finance II BV 0.50% 20 - 14.01.31	200 000	EUR	169 147	172 514	0,73
Allianz Finance II BV 1.375% 16 - 21.04.31	100 000	EUR	86 095	91 641	0,39
American Medical Systems Europe BV 1.625% 22 - 08.03.31	200 000	EUR	175 357	180 730	0,76
Coca-Cola HBC Finance BV 1.625% 19 - 14.05.31	100 000	EUR	85 541	89 920	0,38
Cooperatieve Rabobank UA 1.125% 19 - 07.05.31	200 000	EUR	165 711	171 780	0,72
CTP NV 1.50% 21 - 27.09.31	100 000	EUR	72 450	77 795	0,33
Deutsche Telekom International Finance BV 4.50% 10 - 28.10.30	60 000	EUR	65 059	66 059	0,28
Digital Dutch Finco BV 1.25% 20 - 01.02.31	100 000	EUR	81 908	83 656	0,35
Digital Intrepid Holdings BV 0.625% 21 - 15.07.31	200 000	EUR	149 578	156 906	0,66
DSV Finance BV 0.50% 21 - 03.03.31	100 000	EUR	82 314	83 615	0,35
Euronext NV 0.75% 21 - 17.05.31	100 000	EUR	81 159	83 370	0,35
EXOR NV 0.875% 21 - 19.01.31	100 000	EUR	82 640	86 136	0,36
ING Groep NV 2.50% 18 - 15.11.30	300 000	EUR	280 482	287 217	1,21
Koninklijke KPN NV 3.875% 23 - 03.07.31	100 000	EUR	102 041	103 689	0,44
LYB International Finance II BV 1.625% 19 - 17.09.31	100 000	EUR	84 796	86 880	0,37
Mercedes-Benz International Finance BV 3.70% 23 - 30.05.31	280 000	EUR	285 935	292 661	1,23
RELX Finance BV 3.75% 23 - 12.06.31	200 000	EUR	202 314	208 012	0,88

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.25% 19 - 28.02.31	60 000	EUR	52 641	54 217	0,23
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.375% 23 - 24.08.31	300 000	EUR	304 861	309 291	1,30
Sika Capital BV 1.50% 19 - 29.04.31	100 000	EUR	88 314	90 017	0,38
Stellantis NV 4.25% 23 - 16.06.31	300 000	EUR	301 251	311 268	1,31
Thermo Fisher Scientific Finance I BV 0.80% 21 - 18.10.30	300 000	EUR	253 265	260 373	1,10
Unilever Finance Netherlands BV 1.25% 22 - 28.02.31	100 000	EUR	87 694	89 320	0,38
Unilever Finance Netherlands BV 3.25% 23 - 23.02.31	200 000	EUR	199 628	204 498	0,86
Universal Music Group NV 4.00% 23 - 13.06.31	100 000	EUR	98 772	104 507	0,44
Volkswagen International Finance NV 3.25% 18 - 18.11.30	200 000	EUR	199 696	197 852	0,83
Volkswagen International Finance NV FRN 22 - 31.12.99	300 000	EUR	274 800	271 851	1,14
Wolters Kluwer NV 3.75% 23 - 03.04.31	100 000	EUR	102 072	103 708	0,44
			4 390 614	4 505 102	18,98
Norvège					
Storebrand Livsforsikring AS FRN 21 - 30.09.51	100 000	EUR	77 503	79 675	0,34
			77 503	79 675	0,34
Espagne					
Abertis Infraestructuras SA 3.00% 19 - 27.03.31	200 000	EUR	182 896	190 674	0,80
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 5.125% 23 - 23.04.31	100 000	EUR	103 310	105 551	0,44
Banco Santander SA 1.625% 20 - 22.10.30	200 000	EUR	168 053	172 266	0,73
Telefonica Emisiones SA 2.592% 22 - 25.05.31	200 000	EUR	185 577	192 174	0,81
			639 836	660 665	2,78
Suède					
EQT AB 0.875% 21 - 14.05.31	100 000	EUR	78 043	79 360	0,33
Essity AB 0.25% 21 - 08.02.31	100 000	EUR	85 576	85 178	0,36
Molnlycke Holdings AB 0.625% 20 - 15.01.31	100 000	EUR	79 423	80 846	0,34
SKF AB 0.25% 21 - 15.02.31	100 000	EUR	75 864	79 617	0,34
Telia Co. AB 0.125% 20 - 27.11.30	100 000	EUR	80 495	81 773	0,34
			399 401	406 774	1,71
Suisse					
UBS AG 0.50% 21 - 31.03.31	200 000	EUR	153 031	163 532	0,69
UBS Group AG FRN 22 - 02.04.32	200 000	EUR	181 612	186 840	0,79
UBS Group AG FRN 23 - 17.03.32	200 000	EUR	207 158	210 714	0,89
			541 801	561 086	2,37
Royaume-Uni					
Barclays PLC FRN 21 - 12.05.32	200 000	EUR	157 169	163 060	0,69
Brambles Finance PLC 4.25% 23 - 22.03.31	100 000	EUR	100 873	105 451	0,44
British Telecommunications PLC 3.75% 23 - 13.05.31	100 000	EUR	98 903	102 807	0,43
BUPA Finance PLC 5.00% 23 - 12.10.30	100 000	EUR	104 585	107 426	0,45
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0.70% 19 - 12.09.31	100 000	EUR	78 997	83 682	0,35
HSBC Holdings PLC FRN 20 - 13.11.31	200 000	EUR	160 970	167 638	0,71
HSBC Holdings PLC FRN 23 - 10.03.32	210 000	EUR	215 625	222 031	0,94

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Mobico Group PLC 4.875% 23 - 26.09.31	100 000	EUR	98 334	101 634	0,43
Motability Operations Group PLC 3.50% 23 - 17.07.31	100 000	EUR	100 674	102 520	0,43
Omnicom Finance Holdings PLC 1.40% 19 - 08.07.31	100 000	EUR	89 803	89 560	0,38
Thames Water Utilities Finance PLC 4.375% 23 - 18.01.31	220 000	EUR	202 383	207 625	0,87
Vodafone Group PLC 1.60% 16 - 29.07.31	200 000	EUR	174 169	179 200	0,76
Vodafone Group PLC 1.625% 19 - 24.11.30	200 000	EUR	175 946	181 394	0,76
			1 758 431	1 814 028	7,64
États-Unis					
3M Co. 1.50% 16 - 02.06.31	100 000	EUR	84 834	85 198	0,36
American Tower Corp. 0.95% 21 - 05.10.30	100 000	EUR	79 056	83 869	0,35
American Tower Corp. 4.625% 23 - 16.05.31	100 000	EUR	103 166	105 353	0,44
AT&T Inc. 3.95% 23 - 30.04.31	200 000	EUR	200 425	207 478	0,87
Bank of America Corp. FRN 20 - 26.10.31	310 000	EUR	247 237	253 902	1,07
Bank of America Corp. FRN 21 - 24.05.32	250 000	EUR	203 872	208 325	0,88
BorgWarner Inc. 1.00% 21 - 19.05.31	200 000	EUR	159 522	164 584	0,69
Chubb INA Holdings Inc. 1.40% 19 - 15.06.31	100 000	EUR	86 528	88 072	0,37
Coca-Cola Co. 1.25% 19 - 08.03.31	100 000	EUR	86 913	89 595	0,38
Corning Inc. 4.125% 23 - 15.05.31	200 000	EUR	205 740	209 266	0,88
Fiserv Inc. 4.50% 23 - 24.05.31	100 000	EUR	102 503	106 113	0,45
Global Payments Inc. 4.875% 23 - 17.03.31	100 000	EUR	103 134	104 923	0,44
Goldman Sachs Group Inc. 3.00% 16 - 12.02.31	190 000	EUR	182 967	186 956	0,79
Illinois Tool Works Inc. 1.00% 19 - 05.06.31	100 000	EUR	85 868	88 008	0,37
International Business Machines Corp. 1.75% 19 - 31.01.31	340 000	EUR	302 798	311 947	1,31
International Business Machines Corp. 3.625% 23 - 06.02.31	120 000	EUR	118 122	123 744	0,52
JPMorgan Chase & Co. FRN 23 - 13.11.31	400 000	EUR	415 669	421 640	1,78
Liberty Mutual Group Inc. 4.625% 22 - 02.12.30	120 000	EUR	122 593	125 730	0,53
McDonald's Corp. 1.60% 19 - 15.03.31	100 000	EUR	88 393	89 911	0,38
McDonald's Corp. 3.875% 23 - 20.02.31	100 000	EUR	102 135	103 878	0,44
Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 22 - 05.12.30	200 000	EUR	199 340	205 286	0,87
MMS USA Holdings Inc. 1.75% 19 - 13.06.31	100 000	EUR	88 130	90 496	0,38
Morgan Stanley FRN 22 - 07.05.32	300 000	EUR	277 417	283 926	1,20
PepsiCo Inc. 1.125% 19 - 18.03.31	100 000	EUR	87 249	89 114	0,38
Procter & Gamble Co. 3.25% 23 - 02.08.31	100 000	EUR	98 971	103 154	0,43
Prologis Euro Finance LLC 0.625% 19 - 10.09.31	100 000	EUR	78 497	81 678	0,34
Stryker Corp. 2.625% 18 - 30.11.30	100 000	EUR	95 280	96 792	0,41

Xtrackers II

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Veralto Corp. 4.15% 23 - 19.09.31	100 000	EUR	101 898	103 970	0,44
Verizon Communications Inc. 4.25% 22 - 31.10.30	230 000	EUR	237 623	243 814	1,03
			4 345 880	4 456 722	18,78
Total - Obligations			22 787 488	23 440 036	98,75
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			22 787 488	23 440 036	98,75
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			22 787 488	23 440 036	98,75
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				23 732 442	99,98

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Pacific Airports Melbourne Pty Ltd. 4.375% 23 - 24.05.33	100 000	EUR	101 069	105 773	0,65
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. 4.375% 23 - 03.05.33	200 000	EUR	203 146	210 374	1,29
Transurban Finance Co. Pty Ltd. 4.225% 23 - 26.04.33	100 000	EUR	98 935	105 248	0,64
			403 150	421 395	2,58
Belgique					
Elia Transmission Belgium SA 3.625% 23 - 18.01.33	100 000	EUR	97 955	103 207	0,63
Groupe Bruxelles Lambert NV 4.00% 23 - 15.05.33	100 000	EUR	101 157	105 115	0,64
Lonza Finance International NV 3.875% 23 - 25.05.33	100 000	EUR	99 440	103 752	0,64
			298 552	312 074	1,91
Finlande					
Neste OYJ 4.25% 23 - 16.03.33	100 000	EUR	101 996	106 907	0,66
			101 996	106 907	0,66
France					
Air Liquide Finance SA 0.375% 21 - 20.09.33	100 000	EUR	73 625	79 052	0,49
APRR SA 1.50% 17 - 17.01.33	100 000	EUR	82 456	87 709	0,54
Autoroutes du Sud de la France SA 3.25% 23 - 19.01.33	100 000	EUR	94 950	100 565	0,62
AXA SA 3.625% 23 - 10.01.33	100 000	EUR	98 645	105 866	0,65
AXA SA FRN 22 - 10.03.43	250 000	EUR	237 458	246 850	1,51
AXA SA FRN 23 - 11.07.43	100 000	EUR	100 277	107 098	0,66
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.75% 22 - 01.02.33	200 000	EUR	199 682	204 156	1,25
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 23 - 26.01.33	100 000	EUR	96 612	102 635	0,63
Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.125% 23 - 14.06.33	100 000	EUR	100 205	104 901	0,64
Banque Federative du Credit Mutuel SA 5.125% 23 - 13.01.33	100 000	EUR	103 871	107 062	0,66
BNP Paribas SA 0.625% 20 - 03.12.32	300 000	EUR	223 449	233 706	1,43
BNP Paribas SA 4.125% 23 - 24.05.33	200 000	EUR	200 132	210 860	1,29
BPCE SA 4.00% 22 - 29.11.32	200 000	EUR	202 613	208 948	1,28
BPCE SA 4.50% 23 - 13.01.33	200 000	EUR	203 823	210 176	1,29
BPCE SA FRN 23 - 14.06.34	100 000	EUR	101 807	106 340	0,65
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.25% 20 - 02.11.32	100 000	EUR	76 611	80 332	0,49
Credit Agricole SA 4.00% 23 - 18.01.33	200 000	EUR	202 458	210 344	1,29
Credit Mutuel Arkea SA 0.875% 21 - 11.03.33	100 000	EUR	74 983	79 460	0,49
Credit Mutuel Arkea SA 4.25% 22 - 01.12.32	100 000	EUR	101 661	105 102	0,64
Gecina SA 0.875% 22 - 25.01.33	100 000	EUR	80 187	82 568	0,51
Kering SA 3.375% 23 - 27.02.33	200 000	EUR	197 117	203 734	1,25
Klepierre SA 1.625% 17 - 13.12.32	200 000	EUR	163 307	171 122	1,05
Orange SA 8.125% 03 - 28.01.33	310 000	EUR	424 192	434 651	2,66
PSA Tresorerie GIE 6.00% 03 - 19.09.33	100 000	EUR	112 852	118 174	0,72
Schneider Electric SE 3.50% 22 - 09.11.32	100 000	EUR	99 364	104 322	0,64
Schneider Electric SE 3.50% 23 - 12.06.33	100 000	EUR	102 008	103 893	0,64
Societe Generale SA 4.25% 22 - 16.11.32	200 000	EUR	203 056	212 654	1,30

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
Societe Generale SA 5.625% 23 - 02.06.33	200 000	EUR	202 305	213 238	1,31
Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.375% 21 - 25.05.33	100 000	EUR	77 200	82 240	0,50
Vinci SA 3.375% 22 - 17.10.32	100 000	EUR	98 665	101 798	0,62
			4 335 571	4 519 556	27,70
Allemagne					
Allianz SE FRN 23 - 25.07.53	200 000	EUR	209 864	218 938	1,34
Deutsche Boerse AG 3.875% 23 - 28.09.33	300 000	EUR	308 711	319 224	1,96
Deutsche Post AG 3.375% 23 - 03.07.33	180 000	EUR	179 591	183 784	1,12
Eurogrid GmbH 0.741% 21 - 21.04.33	100 000	EUR	75 411	78 833	0,48
Fresenius SE & Co. KGaA 1.125% 20 - 28.01.33	100 000	EUR	79 400	81 371	0,50
Hannover Rueck SE FRN 22 - 26.08.43	200 000	EUR	215 826	223 146	1,37
Henkel AG & Co. KGaA 0.50% 21 - 17.11.32	100 000	EUR	81 288	82 912	0,51
LEG Immobilien SE 0.875% 21 - 30.03.33	100 000	EUR	71 039	75 467	0,46
LEG Immobilien SE 1.00% 21 - 19.11.32	100 000	EUR	73 074	77 814	0,48
Mercedes-Benz Group AG 0.75% 21 - 11.03.33	200 000	EUR	157 479	165 032	1,01
Talanx AG FRN 21 - 01.12.42	100 000	EUR	80 660	82 695	0,51
Vonovia SE 1.00% 21 - 16.06.33	200 000	EUR	144 884	151 878	0,93
			1 677 227	1 741 094	10,67
Irlande					
CCEP Finance Ireland Dac 0.875% 21 - 06.05.33	200 000	EUR	155 323	161 578	0,99
Linde PLC 0.375% 21 - 30.09.33	100 000	EUR	74 747	77 762	0,48
Smurfit Kappa Treasury ULC 1.00% 21 - 22.09.33	100 000	EUR	76 358	79 839	0,49
			306 428	319 179	1,96
Italie					
Aeroporti di Roma SpA 4.875% 23 - 10.07.33	100 000	EUR	103 151	105 246	0,64
Assicurazioni Generali SpA 5.399% 23 - 20.04.33	200 000	EUR	201 750	212 268	1,30
Intesa Sanpaolo SpA 5.625% 23 - 08.03.33	150 000	EUR	157 492	161 530	0,99
Italgas SpA 0.50% 21 - 16.02.33	100 000	EUR	74 795	76 246	0,47
Terna - Rete Elettrica Nazionale 3.875% 23 - 24.07.33	100 000	EUR	98 353	103 104	0,63
			635 541	658 394	4,03
Japon					
East Japan Railway Co. 1.85% 22 - 13.04.33	100 000	EUR	85 218	89 478	0,55
Mizuho Financial Group Inc. 0.843% 21 - 12.04.33	100 000	EUR	76 852	80 771	0,49
Mizuho Financial Group Inc. 4.416% 23 - 20.05.33	200 000	EUR	202 723	210 396	1,29
			364 793	380 645	2,33
Jersey					
Heathrow Funding Ltd. 4.50% 23 - 11.07.33	100 000	EUR	99 793	106 401	0,65
			99 793	106 401	0,65
Luxembourg					
Holcim Finance Luxembourg SA 0.625% 21 - 19.01.33	200 000	EUR	152 756	156 164	0,96
Medtronic Global Holdings SCA 0.75% 20 - 15.10.32	200 000	EUR	158 726	164 772	1,01
Nestle Finance International Ltd. Zero Coupon 20 - 03.03.33	110 000	EUR	84 046	85 081	0,52
Nestle Finance International Ltd. 3.75% 23 - 13.03.33	200 000	EUR	207 673	214 662	1,32

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 (suite)					
Simon International Finance SCA 1.125% 21 - 19.03.33	100 000	EUR	75 399	80 791	0,49
Traton Finance Luxembourg SA 1.25% 21 - 24.03.33	100 000	EUR	81 204	80 193	0,49
			759 804	781 663	4,79
Pays-Bas					
ABN AMRO Bank NV 1.00% 21 - 02.06.33	200 000	EUR	157 075	165 484	1,01
Akzo Nobel NV 4.00% 23 - 24.05.33	100 000	EUR	101 557	103 633	0,64
BMW Finance NV 0.20% 21 - 11.01.33	100 000	EUR	77 090	78 767	0,48
Cooperatieve Rabobank UA 0.625% 21 - 25.02.33	200 000	EUR	153 185	159 342	0,98
Deutsche Telekom International Finance BV 7.50% 03 - 24.01.33	100 000	EUR	129 844	134 302	0,82
DSV Finance BV 0.75% 21 - 05.07.33	100 000	EUR	76 293	79 796	0,49
GSK Capital BV 3.125% 22 - 28.11.32	100 000	EUR	99 063	101 141	0,62
ING Groep NV FRN 23 - 23.05.34	300 000	EUR	309 728	319 167	1,96
ING Groep NV FRN 22 - 14.11.33	100 000	EUR	107 432	109 781	0,67
JAB Holdings BV 5.00% 23 - 12.06.33	100 000	EUR	103 237	107 800	0,66
JDE Peet's NV 1.125% 21 - 16.06.33	100 000	EUR	75 190	80 103	0,49
Koninklijke KPN NV 0.875% 20 - 14.12.32	100 000	EUR	77 870	81 473	0,50
Lseg Netherlands BV 0.75% 21 - 06.04.33	100 000	EUR	78 522	80 399	0,49
NN Group NV FRN 22 - 01.03.43	100 000	EUR	96 090	102 132	0,63
Prosus NV 1.985% 21 - 13.07.33	200 000	EUR	139 801	147 748	0,91
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.00% 22 - 08.09.33	200 000	EUR	193 662	200 012	1,23
Stellantis NV 1.25% 21 - 20.06.33	250 000	EUR	191 116	201 385	1,23
Telefonica Europe BV 5.875% 03 - 14.02.33	70 000	EUR	79 842	84 045	0,51
Unilever Finance Netherlands BV 1.625% 18 - 12.02.33	200 000	EUR	172 963	179 580	1,10
Volkswagen International Finance NV 3.30% 13 - 22.03.33	200 000	EUR	199 964	197 258	1,21
			2 619 524	2 713 348	16,63
Espagne					
CaixaBank SA FRN 23 - 19.07.34	100 000	EUR	101 595	106 711	0,65
Enagas Financiaciones SA 0.375% 20 - 05.11.32	100 000	EUR	77 987	79 421	0,49
Red Electrica Financiaciones SAU 0.50% 21 - 24.05.33	100 000	EUR	79 817	81 970	0,50
			259 399	268 102	1,64
Suède					
Telia Co. AB 3.50% 13 - 05.09.33	100 000	EUR	98 131	102 558	0,63
			98 131	102 558	0,63
Suisse					
UBS Group AG 0.625% 21 - 18.01.33	300 000	EUR	219 743	226 326	1,39
UBS Group AG 0.625% 21 - 24.02.33	200 000	EUR	142 798	153 388	0,94
			362 541	379 714	2,33
Royaume-Uni					
Barclays PLC FRN 22 - 29.01.34	200 000	EUR	204 908	214 128	1,31

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en EUR)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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)					
British Telecommunications PLC 4.25% 23 - 06.01.33	200 000	EUR	202 099	210 620	1,29
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 3.875% 23 - 14.09.33	100 000	EUR	100 217	105 873	0,65
			507 224	530 621	3,25
États-Unis					
American Tower Corp. 1.25% 21 - 21.05.33	100 000	EUR	76 450	80 505	0,49
AT&T Inc. 3.55% 12 - 17.12.32	300 000	EUR	289 817	300 867	1,84
Booking Holdings Inc. 4.125% 23 - 12.05.33	200 000	EUR	200 572	213 426	1,31
Carrier Global Corp. 4.50% 23 - 29.11.32	150 000	EUR	153 540	160 485	0,98
Coca-Cola Co. 0.375% 20 - 15.03.33	200 000	EUR	153 324	159 156	0,98
Coca-Cola Co. 0.50% 21 - 09.03.33	100 000	EUR	77 188	80 433	0,49
Eli Lilly & Co. 0.50% 21 - 14.09.33	100 000	EUR	77 281	81 434	0,50
Equinix Inc. 1.00% 21 - 15.03.33	100 000	EUR	76 011	80 859	0,50
FedEx Corp. 0.95% 21 - 04.05.33	100 000	EUR	75 409	78 922	0,48
Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 21 - 18.03.33	250 000	EUR	192 185	198 585	1,22
Microsoft Corp. 2.625% 13 - 02.05.33	100 000	EUR	99 559	100 931	0,62
Mondelez International Inc. 0.75% 21 - 17.03.33	100 000	EUR	76 971	80 784	0,49
Morgan Stanley FRN 22 - 25.01.34	300 000	EUR	318 125	329 496	2,02
Nasdaq Inc. 0.90% 21 - 30.07.33	100 000	EUR	73 450	79 261	0,49
PepsiCo Inc. 0.40% 20 - 09.10.32	100 000	EUR	77 362	80 807	0,50
Prologis Euro Finance LLC 4.625% 23 - 23.05.33	200 000	EUR	204 040	213 416	1,31
Unilever Capital Corp. 3.40% 23 - 06.06.33	100 000	EUR	99 010	103 055	0,63
United Parcel Service Inc. 1.50% 17 - 15.11.32	100 000	EUR	85 791	87 804	0,54
Verizon Communications Inc. 1.30% 20 - 18.05.33	200 000	EUR	159 243	166 946	1,02
			2 565 328	2 677 172	16,41
Total - Obligations			15 395 002	16 018 823	98,17
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			15 395 002	16 018 823	98,17
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			15 395 002	16 018 823	98,17
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				16 318 920	100,01

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 20 - 30.06.27	11 500	USD	10 112	10 220	0,82
United States Zero Coupon 20 - 31.10.27	14 600	USD	12 698	12 847	1,04
United States Zero Coupon 21 - 30.04.28	19 300	USD	17 072	17 293	1,40
United States Zero Coupon 21 - 31.05.28	19 300	USD	17 040	17 257	1,39
United States Zero Coupon 21 - 31.07.28	19 000	USD	16 507	16 723	1,35
United States Zero Coupon 21 - 31.08.28	18 800	USD	16 394	16 613	1,34
United States Zero Coupon 21 - 30.09.28	18 900	USD	16 545	16 763	1,35
United States Zero Coupon 21 - 31.12.26	16 400	USD	15 019	15 143	1,22
United States Zero Coupon 21 - 31.12.28	17 400	USD	15 231	15 453	1,25
United States Zero Coupon 22 - 31.01.29	16 500	USD	14 698	14 903	1,20
United States Zero Coupon 22 - 28.02.27	16 500	USD	15 335	15 475	1,25
United States Zero Coupon 22 - 28.02.29	15 600	USD	13 960	14 162	1,14
United States Zero Coupon 22 - 31.03.27	15 900	USD	15 060	15 203	1,23
United States Zero Coupon 22 - 31.03.29	14 600	USD	13 378	13 570	1,10
United States Zero Coupon 22 - 30.04.27	15 200	USD	14 490	14 629	1,18
United States Zero Coupon 22 - 30.04.29	13 700	USD	12 860	13 049	1,05
United States Zero Coupon 22 - 31.07.27	14 300	USD	13 594	13 736	1,11
United States Zero Coupon 22 - 30.11.29	10 900	USD	10 730	10 897	0,88
United States Zero Coupon 23 - 29.02.28	13 400	USD	13 301	13 454	1,09
United States Zero Coupon 23 - 30.04.28	13 400	USD	13 045	13 199	1,07
United States Zero Coupon 23 - 30.06.30	10 900	USD	10 644	10 820	0,87
United States Zero Coupon 23 - 30.09.28	15 200	USD	15 510	15 705	1,27
United States 0.375% 20 - 31.07.27	13 600	USD	11 868	12 003	0,97
United States 0.375% 20 - 30.09.27	14 900	USD	12 932	13 078	1,06
United States 0.50% 20 - 30.04.27	10 000	USD	8 843	8 931	0,72
United States 0.50% 20 - 31.05.27	9 700	USD	8 554	8 641	0,70
United States 0.50% 20 - 31.08.27	11 600	USD	10 146	10 256	0,83
United States 0.625% 20 - 31.03.27	7 000	USD	6 234	6 294	0,51
United States 0.625% 20 - 15.05.30	24 900	USD	20 034	20 383	1,65
United States 0.625% 20 - 15.08.30	32 600	USD	26 006	26 493	2,14
United States 0.625% 20 - 30.11.27	15 600	USD	13 598	13 758	1,11
United States 0.625% 20 - 31.12.27	17 300	USD	15 040	15 220	1,23
United States 0.75% 21 - 31.01.28	19 100	USD	16 648	16 851	1,36
United States 0.875% 20 - 15.11.30	33 800	USD	27 315	27 816	2,25
United States 1.125% 20 - 28.02.27	4 300	USD	3 905	3 940	0,32
United States 1.125% 21 - 29.02.28	19 300	USD	17 056	17 267	1,39
United States 1.25% 21 - 31.03.28	17 500	USD	15 514	15 708	1,27
United States 1.25% 21 - 30.06.28	17 800	USD	15 682	15 887	1,28
United States 1.375% 21 - 31.10.28	17 900	USD	15 735	15 949	1,29
United States 1.50% 20 - 31.01.27	23 800	USD	21 904	22 104	1,78
United States 1.50% 20 - 15.02.30	18 200	USD	15 613	15 880	1,28
United States 1.50% 21 - 30.11.28	17 900	USD	15 802	16 021	1,29
United States 1.625% 19 - 15.08.29	14 100	USD	12 366	12 566	1,01
United States 1.75% 19 - 15.11.29	10 600	USD	9 321	9 475	0,76
United States 1.75% 19 - 31.12.26	6 500	USD	6 044	6 092	0,49
United States 2.25% 17 - 15.02.27	14 300	USD	13 460	13 579	1,10
United States 2.25% 17 - 15.08.27	13 600	USD	12 698	12 831	1,04
United States 2.25% 17 - 15.11.27	14 000	USD	13 023	13 171	1,06

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 2.375% 17 - 15.05.27	17 200	USD	16 189	16 345	1,32
United States 2.375% 19 - 15.05.29	15 300	USD	13 995	14 204	1,15
United States 2.625% 19 - 15.02.29	18 700	USD	17 374	17 629	1,42
United States 2.625% 22 - 31.05.27	14 900	USD	14 130	14 270	1,15
United States 2.625% 22 - 31.07.29	11 800	USD	10 902	11 066	0,89
United States 2.75% 18 - 15.02.28	18 800	USD	17 770	17 979	1,45
United States 2.75% 22 - 31.05.29	13 100	USD	12 205	12 387	1,00
United States 2.875% 18 - 15.05.28	20 000	USD	18 960	19 195	1,55
United States 2.875% 18 - 15.08.28	20 100	USD	19 006	19 252	1,55
United States 3.125% 18 - 15.11.28	18 600	USD	17 750	17 990	1,45
United States 3.125% 22 - 31.08.27	14 000	USD	13 472	13 615	1,10
United States 3.125% 22 - 31.08.29	11 500	USD	10 897	11 062	0,89
United States 3.25% 22 - 30.06.27	14 600	USD	14 133	14 274	1,15
United States 3.25% 22 - 30.06.29	12 400	USD	11 845	12 020	0,97
United States 3.50% 23 - 31.01.28	13 400	USD	13 050	13 198	1,07
United States 3.50% 23 - 31.01.30	10 900	USD	10 509	10 677	0,86
United States 3.50% 23 - 30.04.30	10 900	USD	10 498	10 671	0,86
United States 3.625% 23 - 31.03.28	13 400	USD	13 111	13 264	1,07
United States 3.625% 23 - 31.03.30	10 900	USD	10 574	10 748	0,87
United States 3.625% 23 - 31.05.28	13 400	USD	13 112	13 271	1,07
United States 3.75% 23 - 31.05.30	10 900	USD	10 646	10 820	0,87
United States 3.875% 22 - 30.09.29	11 200	USD	11 030	11 195	0,90
United States 3.875% 22 - 30.11.27	13 400	USD	13 236	13 379	1,08
United States 3.875% 23 - 31.12.27	13 400	USD	13 240	13 389	1,08
United States 3.875% 23 - 31.12.29	10 900	USD	10 727	10 897	0,88
United States 4.00% 22 - 31.10.29	10 900	USD	10 801	10 968	0,89
United States 4.00% 23 - 28.02.30	10 900	USD	10 797	10 969	0,89
United States 4.00% 23 - 30.06.28	13 400	USD	13 312	13 475	1,09
United States 4.00% 23 - 31.07.30	10 900	USD	10 798	10 978	0,89
United States 4.125% 22 - 30.09.27	13 700	USD	13 650	13 793	1,11
United States 4.125% 22 - 31.10.27	13 400	USD	13 350	13 492	1,09
United States 4.125% 23 - 31.07.28	13 400	USD	13 381	13 551	1,09
United States 4.125% 23 - 31.08.30	11 200	USD	11 173	11 359	0,92
United States 4.375% 23 - 31.08.28	14 300	USD	14 438	14 620	1,18
United States 4.375% 23 - 30.11.28	17 100	USD	17 291	17 517	1,41
United States 4.375% 23 - 30.11.30	12 900	USD	13 067	13 289	1,07
United States 4.50% 23 - 30.09.30	11 500	USD	11 810	12 007	0,97
United States 4.875% 23 - 31.10.28	16 200	USD	16 711	16 925	1,37
United States 4.875% 23 - 31.10.30	11 800	USD	12 297	12 502	1,01
United States 5.25% 98 - 15.11.28	2 400	USD	2 515	2 543	0,20
United States 5.25% 99 - 15.02.29	1 300	USD	1 365	1 379	0,11
United States 5.50% 98 - 15.08.28	1 400	USD	1 480	1 496	0,12
United States 6.125% 97 - 15.11.27	2 400	USD	2 563	2 585	0,21
United States 6.125% 99 - 15.08.29	1 200	USD	1 315	1 332	0,11
United States 6.25% 00 - 15.05.30	2 000	USD	2 232	2 261	0,18

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 6.375% 97 - 15.08.27	1 100	USD	1 178	1 186	0,10
United States 6.625% 97 - 15.02.27	900	USD	961	966	0,08
			1 213 410	1 229 298	99,23
Total - Obligations			1 213 410	1 229 298	99,23
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			1 213 410	1 229 298	99,23
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			1 213 410	1 229 298	99,23
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				1 237 973	99,93

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF

État des portefeuilles
au 31 décembre 2023
(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 1.125% 21 - 15.02.31	215 000	USD	177 606	179 794	7,98
United States 1.25% 21 - 15.08.31	234 000	USD	191 820	194 074	8,61
United States 1.375% 21 - 15.11.31	227 000	USD	186 631	188 836	8,38
United States 1.625% 21 - 15.05.31	214 000	USD	181 723	183 873	8,16
United States 1.875% 22 - 15.02.32	215 000	USD	183 028	185 202	8,22
United States 2.75% 22 - 15.08.32	203 000	USD	184 027	186 284	8,27
United States 2.875% 22 - 15.05.32	209 000	USD	191 760	194 043	8,61
United States 3.375% 23 - 15.05.33	203 000	USD	192 697	195 261	8,67
United States 3.50% 23 - 15.02.33	203 000	USD	194 747	197 259	8,76
United States 3.875% 23 - 15.08.33	221 000	USD	218 316	221 173	9,82
United States 4.125% 22 - 15.11.32	203 000	USD	204 211	206 774	9,18
United States 4.50% 24 - 15.11.33	82 000	USD	85 140	86 266	3,83
United States 5.375% 01 - 15.02.31	16 000	USD	17 371	17 505	0,78
			2 209 077	2 236 344	99,27
Total - Obligations			2 209 077	2 236 344	99,27
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			2 209 077	2 236 344	99,27
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			2 209 077	2 236 344	99,27
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				2 252 307	99,99

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 Zero Coupon 20 - 15.05.40	44 100	USD	27 724	28 527	1,16
United States Zero Coupon 21 - 15.05.41	62 600	USD	46 622	47 850	1,95
United States Zero Coupon 21 - 15.08.41	82 100	USD	55 829	57 303	2,34
United States Zero Coupon 22 - 15.02.42	55 800	USD	41 922	42 975	1,75
United States Zero Coupon 22 - 15.05.42	49 300	USD	42 396	43 423	1,77
United States Zero Coupon 23 - 15.02.43	42 700	USD	39 939	40 865	1,67
United States 1.125% 20 - 15.08.40	53 900	USD	33 558	34 530	1,41
United States 1.25% 20 - 15.05.50	65 400	USD	34 503	35 439	1,44
United States 1.375% 20 - 15.08.50	73 700	USD	40 185	41 272	1,68
United States 1.375% 20 - 15.11.40	60 000	USD	38 841	39 956	1,63
United States 1.625% 20 - 15.11.50	73 000	USD	42 572	43 697	1,78
United States 1.875% 21 - 15.02.51	81 400	USD	50 560	51 892	2,11
United States 1.875% 21 - 15.02.41	72 700	USD	51 061	52 469	2,14
United States 1.875% 21 - 15.11.51	75 500	USD	46 773	47 954	1,95
United States 2.00% 20 - 15.02.50	56 300	USD	36 282	37 220	1,52
United States 2.00% 21 - 15.08.51	81 100	USD	51 893	53 209	2,17
United States 2.00% 21 - 15.11.41	69 000	USD	48 797	50 090	2,04
United States 2.25% 16 - 15.08.46	36 200	USD	25 204	25 843	1,05
United States 2.25% 19 - 15.08.49	47 700	USD	32 641	33 457	1,36
United States 2.25% 22 - 15.02.52	69 300	USD	47 112	48 272	1,97
United States 2.375% 19 - 15.11.49	44 800	USD	31 506	32 277	1,32
United States 2.375% 21 - 15.05.51	82 000	USD	57 354	58 797	2,40
United States 2.50% 15 - 15.02.45	36 000	USD	26 731	27 354	1,11
United States 2.50% 16 - 15.02.46	29 000	USD	21 287	21 836	0,89
United States 2.50% 16 - 15.05.46	29 300	USD	21 489	22 016	0,90
United States 2.75% 12 - 15.08.42	16 900	USD	13 486	13 750	0,56
United States 2.75% 12 - 15.11.42	24 000	USD	19 026	19 466	0,79
United States 2.75% 17 - 15.08.47	35 500	USD	27 094	27 768	1,13
United States 2.75% 17 - 15.11.47	35 700	USD	27 225	27 913	1,14
United States 2.875% 13 - 15.05.43	33 200	USD	26 766	27 354	1,11
United States 2.875% 15 - 15.08.45	23 800	USD	18 791	19 256	0,78
United States 2.875% 16 - 15.11.46	16 300	USD	12 818	13 101	0,53
United States 2.875% 19 - 15.05.49	50 700	USD	39 516	40 473	1,65
United States 2.875% 22 - 15.05.52	65 700	USD	51 319	52 550	2,14
United States 3.00% 12 - 15.05.42	14 400	USD	11 981	12 227	0,50
United States 3.00% 14 - 15.11.44	27 000	USD	21 928	22 418	0,91
United States 3.00% 15 - 15.05.45	17 500	USD	14 196	14 484	0,59
United States 3.00% 15 - 15.11.45	14 100	USD	11 402	11 639	0,47
United States 3.00% 17 - 15.02.47	32 200	USD	25 787	26 424	1,08
United States 3.00% 17 - 15.05.47	24 800	USD	19 856	20 340	0,83
United States 3.00% 18 - 15.02.48	40 900	USD	32 668	33 468	1,36
United States 3.00% 18 - 15.08.48	48 300	USD	38 546	39 485	1,61
United States 3.00% 19 - 15.02.49	51 200	USD	40 827	41 848	1,71
United States 3.00% 22 - 15.08.52	62 400	USD	50 041	51 265	2,09
United States 3.125% 11 - 15.11.41	14 700	USD	12 556	12 823	0,52
United States 3.125% 12 - 15.02.42	15 500	USD	13 192	13 478	0,55
United States 3.125% 13 - 15.02.43	21 000	USD	17 677	18 017	0,73
United States 3.125% 14 - 15.08.44	30 800	USD	25 584	26 156	1,07

Les notes complémentaires font partie intégrante de ces États financiers.

Xtrackers II

Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF (suite)

État des portefeuilles

au 31 décembre 2023

(exprimé en USD)

Description	Valeur nominale	Devise (locale)	Coût	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 3.125% 18 - 15.05.48	43 900	USD	35 856	36 725	1,50
United States 3.375% 14 - 15.05.44	23 900	USD	20 691	21 140	0,86
United States 3.375% 18 - 15.11.48	50 300	USD	43 007	44 012	1,79
United States 3.375% 22 - 15.08.42	42 700	USD	37 278	38 216	1,56
United States 3.50% 09 - 15.02.39	8 000	USD	7 424	7 598	0,31
United States 3.625% 13 - 15.08.43	23 800	USD	21 489	21 959	0,90
United States 3.625% 14 - 15.02.44	24 800	USD	22 303	22 793	0,93
United States 3.625% 23 - 15.02.53	62 400	USD	56 512	57 886	2,36
United States 3.625% 23 - 15.05.53	62 500	USD	56 673	58 057	2,37
United States 3.75% 11 - 15.08.41	14 000	USD	13 088	13 368	0,54
United States 3.75% 13 - 15.11.43	24 200	USD	22 216	22 684	0,92
United States 3.875% 10 - 15.08.40	14 200	USD	13 570	13 889	0,57
United States 3.875% 23 - 15.05.43	42 500	USD	39 784	40 674	1,66
United States 4.00% 22 - 15.11.52	62 900	USD	60 915	62 330	2,54
United States 4.00% 22 - 15.11.42	42 700	USD	40 730	41 653	1,70
United States 4.125% 23 - 15.08.53	69 000	USD	68 436	70 078	2,86
United States 4.25% 09 - 15.05.39	12 300	USD	12 349	12 711	0,52
United States 4.25% 10 - 15.11.40	14 100	USD	14 088	14 415	0,59
United States 4.375% 08 - 15.02.38	7 800	USD	8 063	8 220	0,34
United States 4.375% 09 - 15.11.39	14 600	USD	14 849	15 255	0,62
United States 4.375% 10 - 15.05.40	14 300	USD	14 547	14 897	0,61
United States 4.375% 11 - 15.05.41	13 800	USD	13 978	14 270	0,58
United States 4.375% 23 - 15.08.43	46 000	USD	46 114	47 128	1,92
United States 4.50% 06 - 15.02.36	8 300	USD	8 716	8 872	0,36
United States 4.50% 08 - 15.05.38	9 400	USD	9 790	10 017	0,41
United States 4.50% 09 - 15.08.39	13 500	USD	13 990	14 331	0,58
United States 4.625% 10 - 15.02.40	14 800	USD	15 541	15 894	0,65
United States 4.75% 07 - 15.02.37	4 400	USD	4 730	4 827	0,20
United States 4.75% 11 - 15.02.41	14 900	USD	15 798	16 162	0,66
United States 4.75% 23 - 15.11.43	18 100	USD	19 084	19 480	0,79
United States 4.75% 24 - 15.11.53	26 600	USD	29 273	29 971	1,22
United States 5.00% 07 - 15.05.37	6 600	USD	7 195	7 399	0,30
			2 373 140	2 431 137	99,08
Total - Obligations			2 373 140	2 431 137	99,08
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs			2 373 140	2 431 137	99,08
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS			2 373 140	2 431 137	99,08
TOTAL DU PORTEFEUILLE D'INVESTISSEMENTS DONT INTÉRÊTS COURUS				2 452 655	99,96

Les notes complémentaires 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 et ont été publiés dans le 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 31 décembre 2023, tous les Compartiments de la Société sont des fonds indiciels négociés en bourse (exchange traded funds, « ETF »).

Au 31 décembre 2023, la Société comprenait 52 Compartiments actifs.

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.

En ce qui concerne l'ensemble des Compartiments de la Société, à l'exception des Compartiments cités au point 1 de la section Événements significatifs des Notes aux États financiers, le Conseil d'administration est d'avis qu'il n'existe aucun signe mettant en doute la capacité de ces Compartiments à être maintenus ni aucun problème de liquidité pour ces Compartiments.

Événements significatifs au cours de l'exercice :

1. Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, les Compartiments suivants ont été liquidés :

Compartiment	Date de liquidation
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	22 mars 2023
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	26 avril 2023

1. Généralités (suite)

a) La Société (suite)

2. Les catégories d'actions suivantes ont réduit leurs commissions comme indiqué dans le tableau ci-dessous à compter du 1^{er} décembre 2023 :

Compartiment	Catégorie d'actions/Code ISIN	Ancienne Commission de Société de gestion (par an)	Nouvelle Commission de Société de gestion (par an)	Anciennes Commissions fixes (par an)	Nouvelles Commissions fixes (par an)	Ancienne Commission globale (par an)	Nouvelle Commission globale (par an)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C / LU0290355717	Jusqu'à 0,05 %	Jusqu'à 0,01 %	0,10 %	0,08 %	Jusqu'à 0,15 %	Jusqu'à 0,09 %
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D / LU0321464652	Jusqu'à 0,05 %	Jusqu'à 0,02 %	0,10 %	0,08 %	Jusqu'à 0,15 %	Jusqu'à 0,10 %
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C / LU0321465469	Jusqu'à 0,05 %	Jusqu'à 0,02 %	0,10 %	0,08 %	Jusqu'à 0,15 %	Jusqu'à 0,10 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged / LU0942970285	Jusqu'à 0,06 %	Jusqu'à 0,01 %	0,09 % (aucune modification)	0,09 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,15 %	Jusqu'à 0,10 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged / LU0942970368	Jusqu'à 0,06 %	Jusqu'à 0,01 %	0,09 % (aucune modification)	0,09 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,15 %	Jusqu'à 0,10 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged / LU0942970442	Jusqu'à 0,06 %	Jusqu'à 0,01 %	0,09 % (aucune modification)	0,09 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,15 %	Jusqu'à 0,10 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	5C - EUR Hedged / LU0942970798	Jusqu'à 0,06 %	Jusqu'à 0,01 %	0,09 % (aucune modification)	0,09 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,15 %	Jusqu'à 0,10 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged / LU0962078753	Jusqu'à 0,15 %	Jusqu'à 0,10 %	0,10 % (aucune modification)	0,10 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,25 %	Jusqu'à 0,20 %
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1C / LU1920015523	Jusqu'à 0,01 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,01 % (aucune modification)	0,06 %	0,05 %	Jusqu'à 0,07 %	Jusqu'à 0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D / LU0429458895	Jusqu'à 0,01 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,01 % (aucune modification)	0,06 %	0,05 %	Jusqu'à 0,07 %	Jusqu'à 0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1C / LU1920015796	Jusqu'à 0,01 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,01 % (aucune modification)	0,06 %	0,05 %	Jusqu'à 0,07 %	Jusqu'à 0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D / LU0429459356	Jusqu'à 0,01 % (aucune modification)	Jusqu'à 0,01 % (aucune modification)	0,06 %	0,05 %	Jusqu'à 0,07 %	Jusqu'à 0,06 %

Pour les autres modifications apportées à la Société au cours de cette période, veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de la période, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » aux États financiers du présent rapport annuel.

1. Généralités (suite)

b) Objectifs et politiques d'investissement

Un Compartiment répliqueur d'indice est autorisé à atteindre son 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.

Compartiments répliqueurs d'indice dotés d'une Politique d'investissement indirect

Les Compartiments répliqueurs d'indice dotés d'une Politique d'investissement indirect sont identifiés par la référence « SWAP » dans leur nom. Les Compartiments répliqueurs d'indice dotés d'une Politique d'investissement indirect (les « Compartiments à réplication indirecte ») ne peuvent pas investir directement dans les composants de leur 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 (la/les « Transaction(s) sur des instruments dérivés »). En particulier, le 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 « Opération(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 des swaps 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 sur titres et de leur réutilisation et modifiant le Règlement (UE) N° 648/2012 (le « Règlement SFTR »). Les Compartiments à réplication indirecte ne prévoient 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. 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 indirecte.

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 Transaction(s) 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 Note 4) ; et/ou
- (b) dans une ou plusieurs Transaction(s) 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 »).

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 des opérations de couverture contre le 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 est de 100 % de la Valeur liquidative, à l'exclusion de l'incidence des frais et des opérations de couverture contre le risque de change, selon le cas, sauf mention contraire dans l'Annexe produit correspondante.

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 % de la Valeur liquidative, à l'exclusion de l'incidence des frais et des opérations de couverture contre le 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 % de la Valeur liquidative, à l'exclusion de l'incidence des frais et des opérations de couverture contre le risque de change, selon le cas, sauf mention contraire dans l'Annexe produit correspondante.

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 contrepartie(s) (y compris une ou plusieurs Contrepartie(s) 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 et EMIR (voir Note 9).

Notes aux États financiers (suite)

1. Généralités (suite)

b) Objectifs et politiques d'investissement (suite)

Compartiments répliqueurs d'indice dotés d'une Politique d'investissement direct

Les Compartiments dotés d'une Politique d'investissement direct (« 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 :

(i) la totalité ou une partie importante des composants de l'Indice de référence (ce Compartiment étant un « 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 Compartiment étant un « Compartiment à réplication optimisée »).

Les Compartiments à réplication optimisée peuvent ne pas détenir tous les composants ou une pondération identique à tous ces composants de l'Indice de référence. Ils viseront 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 efficace de portefeuille.

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 des swaps 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 américains de dépôt (« ADR »), les Certificats internationaux de dépôt (« GDR ») et/ou les Certificats de dépôt sans droit de vote (« NVDR »). Les Compartiments à réplication directe peuvent également investir dans des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire et des fonds du marché monétaire dans le but de réaliser leur objectif d'investissement et/ou aux fins de trésorerie. 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 d'investissements 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 (Tracking Error).

Le Gestionnaire d'investissement peut exclure des portefeuilles des Compartiments certains titres, comme indiqué plus en détail dans la section intitulée « Publication d'informations en matière de durabilité dans le cadre du SFDR et du Règlement européen sur la taxinomie » du Prospectus.

En outre, le Gestionnaire d'investissement se réserve le droit d'exclure de tout portefeuille des Compartiments les titres ne se conformant pas avec les politiques du Gestionnaire d'investissement.

Nonobstant ce qui précède, il convient de noter qu'en raison de circonstances exceptionnelles comme, entre autres, une perturbation des conditions de marché ou une volatilité extrême sur les marchés, des situations 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. En raison de divers facteurs, au nombre desquels les frais et charges applicables au Compartiment, les limites de concentration énoncées dans les Restrictions d'investissement, les autres restrictions légales ou réglementaires et, dans certains cas, l'illiquidité de certains titres, il peut se révéler impossible ou irréalisable d'acheter l'ensemble des composants dans les mêmes proportions que leur pondération dans l'Indice de référence, voire d'en acheter certains.

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 peuvent être offertes présentant des caractéristiques spécifiques (notamment en termes de grille de commissions, de montant minimum de souscription, de critères d'éligibilité des investisseurs ou d'autres caractéristiques spécifiques). Les Actions seront cotées à des fins de négociation 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 fonds 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 :

- (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 la véritable valeur de ces instruments, le cas échéant ;
- (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 à son dernier cours de bourse publié le Jour ouvrable précédant immédiatement le Jour d'évaluation ou sur la base des derniers cours disponibles sur le marché principal de négociation 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 prix 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 disponible ou à toute autre source qu'il jugera, à sa libre appréciation, appropriée ;
- (iii) les titres ni cotés ni échangés 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 seront 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 à terme ou des contrats d'options négociés sur des bourses de valeurs ou d'autres marchés organisés sera 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 à terme ou un contrat d'options ne peut pas être liquidé le Jour ouvrable auquel est calculée la Valeur liquidative, la base de calcul de ladite valeur de liquidation du contrat en question correspondra à la valeur estimée juste et raisonnable par le Conseil d'administration. La plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les opérations de change à terme 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 couru 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 corrective 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 de swaps de rendement total (« TRS ») seront évaluées de manière constante 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 VL ;
- (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 conformément aux procédures établies par le Conseil d'administration.

b) Opérations d'investissement

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

2. Principes comptables (suite)

b) Opérations d'investissement (suite)

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 registres 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.

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

Les éléments d'actif et d'engagements en devises autres que la devise de référence du 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 31 décembre 2023 sont les suivants :

1 Euro = 1,618891 AUD	1 Euro = 155,733576 JPY
1 Euro = 5,365948 BRL	1 Euro = 1 422,678909 KRW
1 Euro = 1,456592 CAD	1 Euro = 18,706698 MXN
1 Euro = 0,929729 CHF	1 Euro = 5,075867 MYR
1 Euro = 964,674393 CLP	1 Euro = 11,218495 NOK
1 Euro = 7,834400 CNY	1 Euro = 1,744690 NZD
1 Euro = 4 279,414624 COP	1 Euro = 4,090078 PEN
1 Euro = 24,688489 CZK	1 Euro = 4,343760 PLN
1 Euro = 7,454566 DKK	1 Euro = 4,974902 RON
1 Euro = 34,161305 EGP	1 Euro = 11,132498 SEK
1 Euro = 0,866528 GBP	1 Euro = 1,457144 SGD
1 Euro = 8,625716 HKD	1 Euro = 37,704471 THB
1 Euro = 382,215078 HUF	1 Euro = 32,624737 TRY
1 Euro = 17 008,298130 IDR	1 Euro = 1,104650 USD
1 Euro = 3,977735 ILS	1 Euro = 20,201289 ZAR

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 ». Les dividendes sont comptabilisés à la date de détachement, nets après déduction de la retenue à la source.

e) Valeur liquidative

Le présent rapport annuel est établi sur la base de la dernière valeur liquidative des Compartiments disponible au 31 décembre 2023.

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 de 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 d'instruments à des fins de couverture ou de gestion efficace de portefeuille. La réglementation luxembourgeoise peut imposer des critères supplémentaires ou différents aux indices concernés par cette exemption.

3. Fiscalité de la Société (suite)

La Société ou ses Compartiments peuvent bénéficier de taux réduits de la taxe d'abonnement en fonction de la valeur de l'actif net du Compartiment concerné investi dans des activités économiques considérées comme respectueuses de l'environnement au sens de l'Article 3 du Règlement européen sur la taxinomie (les « Activités admissibles »), à l'exception de la proportion de l'actif net de la Société ou de ses Compartiments, investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

4. Swaps de rendement total

Les Compartiments ayant une politique d'investissement indirecte (synthétique) n'investissent pas directement dans les composants de l'Indice de référence concerné, mais bénéficient de la performance de l'Indice de référence par le biais d'une structure de swap de rendement total.

Dans cette construction, le swap de rendement total vise à compenser la performance du panier de substitution, tout en bénéficiant de la performance de l'Indice de référence.

Au cours de l'exercice, une nouvelle méthodologie a été mise en place concernant l'enregistrement comptable des plus-values et moins-values latentes et réalisées sur les opérations de swap et le panier de substitution.

La nouvelle méthodologie reflète désormais mieux en comptabilité la symétrie des plus-values et moins-values latentes et réalisées sur les swaps et le panier de substitution, ce qui permet de mieux aligner la comptabilité sur la réalité économique des transactions.

La nouvelle méthodologie ne devrait pas avoir d'impact sur la Valeur liquidative ni sur la performance des Compartiments. Étant donné que la méthodologie a été mise en œuvre au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023 et que les transactions ont été enregistrées avec deux méthodologies différentes au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, une symétrie totale dans les comptes réalisés pour le swap et le panier de substitution ne sera atteinte qu'à la fin de la prochaine période de présentation de l'information financière.

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 instruments du marché monétaire, y compris les intérêts courus nets payés, pouvant devenir supérieur ou inférieur à la valeur nominale de l'Indice de référence du fait d'achats/de ventes complémentaires de valeurs mobilières et d'instruments du marché monétaire par rapport à la valeur nominale de l'indice.

Le « Montant net de la Contrepartie de swap et résultat latent sur swap » indiqué dans l'État de l'actif net représente les plus-values/(moins-values) nettes sur les Swaps de rendement total, ajustées pour (i) les coûts des Swaps de rendement total et (ii) leurs commissions (à savoir les charges pour l'amélioration).

La répartition de la plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swap et la variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap indiquée dans l'État des opérations au 31 décembre 2023 est indiquée dans le tableau ci-dessous.

Compartiment	Actif sous-jacent/Indice de référence	Devise	Plus-value/ (moins-value) nette réalisée sur swap	Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swap
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	SOLACTIVE €STR +8.5 DAILY TOTAL RETURN INDEX	EUR	(81 797 318)	(160 641 309)
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® EUROPE 5-YEAR TOTAL RETURN INDEX	EUR	246 867	(234 586)
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® CROSSOVER 5-YEAR TOTAL RETURN INDEX	EUR	9 139 239	(7 195 545)
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® CROSSOVER 5-YEAR SHORT TOTAL RETURN INDEX	EUR	(1 714 550)	(5 128 753)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	SHORT IBOXX® € SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX	EUR	11 490 992	(12 670 342)
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	IBOXX € GERMANY COVERED® INDEX	EUR	7 598 107	(5 855 450)
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	SOLACTIVE FEDL DAILY TOTAL RETURN INDEX	USD	6 812 401	(17 191 768)
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	SOLACTIVE SONIA DAILY TOTAL RETURN INDEX	GBP	15 017 199	(10 989 057)
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE AAA® INDEX	EUR	3 732 949	(3 127 628)
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	FTSE EUROZONE BOT (WEEKLY) INDEX	EUR	13 982 710	(13 088 780)
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID COVERED INDEX®	EUR	565 980	(527 915)
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID HIGH YIELD 1-3 INDEX	EUR	13 926 270	(9 828 596)

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

4. Swaps de rendement total (suite)

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 Swaps de rendement total sous la forme d'un montant absolu et d'une proportion de la Valeur liquidative des Compartiments. Le pourcentage de l'actif net publié dans le tableau ci-dessus est calculé sur la base de la plus-value/(moins-value) latente sur les swaps, 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 de référence) au 31 décembre 2023.

Compartiment	Actif sous-jacent/Indice de référence	Devise	Exposition - Actifs investis	Exposition - Actifs investis en % de l'actif net	Exposition - Actif sous-jacent	Exposition - Actif sous-jacent en % de l'actif net
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	SOLACTIVE €STR +8,5 DAILY TOTAL RETURN INDEX	EUR	4 682 831 001	98,11 %	4 772 885 338	100,00 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	MARKIT ITRAXX® CROSSOVER 5-YEAR SHORT TOTAL RETURN INDEX	EUR	34 969 796	98,49 %	35 513 317	100,02 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	SHORT IBOXX® € SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX	EUR	16 158 380	96,68 %	16 713 519	100,00 %
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	IBOXX € GERMANY COVERED® INDEX	EUR	24 813 450	98,67 %	25 155 136	100,03 %
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	SOLACTIVE FEDL DAILY TOTAL RETURN INDEX	USD	248 505 870	95,84 %	259 307 294	100,00 %
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	SOLACTIVE SONIA DAILY TOTAL RETURN INDEX	GBP	59 823 981	96,39 %	62 065 877	100,00 %
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	IBOXX € SOVEREIGNS EUROZONE AAA® INDEX	EUR	11 169 001	97,18 %	11 492 709	100,00 %
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	FTSE EUROZONE BOT (WEEKLY) INDEX	EUR	54 100 042	98,28 %	55 050 989	100,01 %
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID COVERED INDEX®	EUR	2 225 930	97,49 %	2 283 664	100,02 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID HIGH YIELD 1-3 INDEX	EUR	85 660 690	98,51 %	87 034 757	100,09 %

Comme l'exige le Règlement relatif aux opérations de financement sur titres (voir Note 5), la Société a l'obligation de publier séparément les 10 principales contreparties de swaps de rendement total.

Au 31 décembre 2023, Deutsche Bank AG est la contrepartie aux conventions de swap conclues par la Société, sauf pour le Compartiment ci-après qui a d'autres contreparties et/ou des contreparties de swaps multiples.

Compartiment	Actif sous-jacent	Devise	Contrepartie	Valeur nominale - Actif investi	Valeur nominale - Actif sous-jacent	Produit à recevoir de/ (Montant à payer à) la contrepartie de swap	Plus-value/ (moins-value) latente sur swap
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	MARKIT IBOXX EUR LIQUID HIGH YIELD 1-3 INDEX	EUR	Goldman Sachs International (Royaume-Uni)	(79 106 277)	78 955 781	(150 496)	(2 864 358)
		EUR	Société Générale SA (France)	(5 011 931)	4 192 863	(819 068)	5 145 676
			Total	(84 118 208)	83 148 644	(969 564)	2 281 318

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

Toutes les positions ouvertes à la fin de l'exercice clos le 31 décembre 2023 ont été exécutées par règlement bilatéral.

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 leur réutilisation et modifiant le Règlement (UE) N° 648/2012 du Parlement européen (le « Règlement SFTR »).

Une Opération de financement sur titres (« OFT ») est définie dans l'Article 3, paragraphe 11 du Règlement SFTR comme :

5. Opérations de financement sur titres (suite)

- ▶ 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 cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, la Société a exécuté 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 Swaps de rendement total ou TRS (voir Note 4). Au 31 décembre 2023, la Société détenait des swaps de rendement total.

Au 31 décembre 2023, aucun réinvestissement de garanties en numéraire n'avait été réalisé pour les différents Compartiments.

6. Contrats à terme ferme (« futures »)

Au 31 décembre 2023, les Compartiments à réplification directe suivants présentaient le contrat 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	200 000	EUR	274 440	07/03/2024	(1 653)
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF					
Euro-Bund	700 000	EUR	960 540	07/03/2024	24 080

7. Contrats de change à terme

Au 31 décembre 2023, 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
GBP	418 720	EUR	481 559	02/02/2024	1 170
USD	2 996 888	EUR	2 695 334	02/02/2024	14 468
Plus-value nette latente					15 638

Barclays Bank Ireland PLC, HSBC Continental Europe et State Street Bank International GmbH sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouverts.

Au 31 décembre 2023, le Compartiment Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 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
GBP	233 815	EUR	268 904	02/02/2024	655
USD	693 766	EUR	623 850	02/02/2024	3 456
Plus-value nette latente					4 111

Barclays Bank Ireland PLC et HSBC Continental Europe sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouverts.

Au 31 décembre 2023, le Compartiment Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 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
EUR	6 228 600	USD	6 925 897	02/02/2024	(33 830)

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value/ (moins-value) latente EUR
GBP	19 926 465	EUR	22 919 876	02/02/2024	52 730
USD	416 972 340	EUR	375 015 466	02/02/2024	2 012 980
Plus-value nette latente					2 031 880

Barclays Bank Ireland PLC, HSBC Continental Europe et UBS AG sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouvert.

Au 31 décembre 2023, 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 EUR
CHF	465 438	AUD	805 904	02/02/2024	3 828
CHF	705 717	CAD	1 105 829	02/02/2024	1 848
CHF	58 334	DKK	463 897	02/02/2024	608
CHF	8 185 364	EUR	8 736 160	02/02/2024	84 129
CHF	9 052 777	GBP	8 401 220	02/02/2024	69 479
CHF	1 051 539	JPY	176 469 044	02/02/2024	(3 707)
CHF	207 304	NZD	387 989	02/02/2024	1 235
CHF	309 405	SEK	3 638 908	02/02/2024	6 525
CHF	21 889 804	USD	25 968 973	02/02/2024	106 487
EUR	7 845 629	AUD	12 723 845	02/02/2024	(12 426)
EUR	11 894 361	CAD	17 459 161	02/02/2024	(82 798)
EUR	990 545	DKK	7 382 179	02/02/2024	(75)
EUR	152 565 149	GBP	132 640 957	02/02/2024	(352 512)
EUR	17 899 202	JPY	2 815 136 413	02/02/2024	(235 897)
EUR	3 560 626	NZD	6 245 505	02/02/2024	(15 330)
EUR	5 112 651	SEK	56 319 453	02/02/2024	53 518
EUR	368 802 422	USD	410 064 258	02/02/2024	(1 979 702)
GBP	2 130 076	AUD	3 972 869	02/02/2024	2 115
GBP	3 229 407	CAD	5 451 415	02/02/2024	(16 641)
GBP	271 146	DKK	2 324 180	02/02/2024	712
GBP	37 441 725	EUR	43 066 717	02/02/2024	98 690
GBP	4 877 079	JPY	882 200 686	02/02/2024	(60 500)
GBP	970 269	NZD	1 957 192	02/02/2024	(2 026)
GBP	1 393 109	SEK	17 649 240	02/02/2024	20 654
GBP	100 184 993	USD	128 132 034	02/02/2024	(357 434)
JPY	28 990 691	EUR	185 917	02/02/2024	841
JPY	12 259 872	GBP	68 442	02/02/2024	73
JPY	4 256 685	USD	30 350	02/02/2024	(21)
USD	626 177	AUD	913 143	02/02/2024	2 249
USD	949 315	CAD	1 252 978	02/02/2024	(1 180)
USD	78 876	DKK	528 573	02/02/2024	390
USD	11 064 501	EUR	9 951 165	02/02/2024	53 412
USD	12 288 006	GBP	9 607 291	02/02/2024	34 926
USD	1 443 950	JPY	204 207 886	02/02/2024	(9 880)
USD	279 989	NZD	441 600	02/02/2024	322

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 EUR
USD	412 425	SEK	4 085 376	02/02/2024	5 930
Moins-value nette latente					(2 582 158)

Barclays Bank Ireland PLC, BNP Paribas SA, Citigroup Global Markets Europe AG, HSBC Continental Europe, Royal Bank Of Canada (UK), State Street Bank International GmbH et UBS AG sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouverts.

Au 31 décembre 2023, le Compartiment Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF avait conclu le contrat de change à terme suivant :

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value/ (moins-value) latente USD
EUR	146 397 173	USD	162 776 149	02/02/2024	(869 093)
Moins-value nette latente					(869 093)

HSBC Continental Europe et Royal Bank Of Canada (UK) sont les contreparties à ce contrat de change à terme ouvert.

Au 31 décembre 2023, 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 EUR
AUD	87 800	EUR	54 229	02/02/2024	(5)
CAD	115 200	EUR	78 605	02/02/2024	423
CHF	4 033 582	AUD	6 985 383	02/02/2024	32 393
CHF	5 841 967	CAD	9 159 618	02/02/2024	11 529
CHF	755 641	DKK	6 012 337	02/02/2024	7 454
CHF	94 558 464	EUR	100 975 059	02/02/2024	918 152
CHF	15 383 295	GBP	14 291 350	02/02/2024	100 497
CHF	916 719	ILS	3 942 064	02/02/2024	(2 613)
CHF	38 096 505	JPY	6 394 353 782	02/02/2024	(140 816)
CHF	518 142	NOK	6 207 345	02/02/2024	5 255
CHF	703 615	NZD	1 318 543	02/02/2024	3 242
CHF	569 194	SEK	6 695 321	02/02/2024	11 910
CHF	1 167 625	SGD	1 827 418	02/02/2024	3 854
CHF	133 858 969	USD	158 887 550	02/02/2024	575 287
DKK	80 700	EUR	10 832	02/02/2024	(2)
EUR	12 999 620	AUD	21 082 219	02/02/2024	(20 443)
EUR	18 834 262	CAD	27 644 368	02/02/2024	(130 052)
EUR	2 473 794	DKK	18 436 256	02/02/2024	(181)
EUR	49 607 335	GBP	43 131 587	02/02/2024	(117 740)
EUR	2 956 889	ILS	11 897 247	02/02/2024	(32 281)
EUR	122 735 076	JPY	19 298 409 239	02/02/2024	(1 585 210)
EUR	1 649 649	NOK	18 465 644	02/02/2024	4 345
EUR	2 273 679	NZD	3 986 590	02/02/2024	(8 902)
EUR	1 849 328	SEK	20 373 175	02/02/2024	19 221
EUR	3 826 310	SGD	5 609 657	02/02/2024	(24 162)
EUR	431 352 177	USD	479 613 001	02/02/2024	(2 316 265)
GBP	6 694 151	AUD	12 485 523	02/02/2024	6 610
GBP	9 699 278	CAD	16 371 820	02/02/2024	(49 236)

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value/ (moins-value) latente EUR
GBP	1 277 024	DKK	10 946 215	02/02/2024	3 361
GBP	157 088 508	EUR	180 686 512	02/02/2024	415 975
GBP	1 522 763	ILS	7 045 865	02/02/2024	(14 720)
GBP	63 187 782	JPY	11 429 082 808	02/02/2024	(778 870)
GBP	852 381	NOK	10 971 199	02/02/2024	5 140
GBP	1 171 155	NZD	2 361 364	02/02/2024	(1 845)
GBP	953 678	SEK	12 082 176	02/02/2024	14 134
GBP	1 977 125	SGD	3 333 620	02/02/2024	(8 834)
GBP	222 050 376	USD	283 990 999	02/02/2024	(791 043)
ILS	49 600	EUR	12 311	02/02/2024	151
JPY	80 394 800	EUR	515 537	02/02/2024	2 366
JPY	13 230 778	USD	94 336	02/02/2024	(67)
NOK	78 100	EUR	6 932	02/02/2024	26
NZD	23 600	EUR	13 484	02/02/2024	29
NZD	4 600	GBP	2 280	02/02/2024	5
NZD	6 500	USD	4 121	02/02/2024	(5)
SEK	90 500	EUR	8 191	02/02/2024	(61)
SGD	23 700	EUR	16 213	02/02/2024	55
USD	4 388 740	AUD	6 400 304	02/02/2024	15 589
USD	6 431 542	CAD	8 488 557	02/02/2024	(7 804)
USD	852 649	DKK	5 713 886	02/02/2024	4 218
USD	106 127 623	EUR	95 448 736	02/02/2024	512 385
USD	16 938 736	GBP	13 244 129	02/02/2024	47 342
USD	1 009 677	ILS	3 653 193	02/02/2024	(4 906)
USD	41 994 963	JPY	5 939 057 847	02/02/2024	(287 338)
USD	569 150	NOK	5 727 444	02/02/2024	4 308
USD	779 140	NZD	1 228 462	02/02/2024	1 129
USD	627 166	SEK	6 212 545	02/02/2024	9 018
USD	1 350 457	SGD	1 780 366	02/02/2024	(954)
Moins-value nette latente					(3 588 952)

Barclays Bank Ireland PLC, BNP Paribas SA, Citigroup Global Markets Europe AG, HSBC Continental Europe, Royal Bank Of Canada (UK), State Street Bank International GmbH et UBS AG sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouverts.

Au 31 décembre 2023, 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 USD
EUR	1 570 282 219	USD	1 745 966 505	02/02/2024	(9 322 520)
GBP	7 339 406	USD	9 387 260	02/02/2024	(29 455)
USD	14 281 900	EUR	12 843 198	02/02/2024	78 044
Moins-value nette latente					(9 273 931)

Citigroup Global Markets Europe AG, HSBC Continental Europe, Royal Bank Of Canada (UK) et State Street Bank International GmbH sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouverts.

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

7. Contrats de change à terme (suite)

Au 31 décembre 2023, le Compartiment Xtrackers II GERMANY 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
GBP	26 180 818	EUR	30 113 685	02/02/2024	69 372
USD	481 439 218	EUR	432 995 581	02/02/2024	2 324 133
Plus-value nette latente					2 393 505

Barclays Bank Ireland PLC et HSBC Continental Europe sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouverts.

Au 31 décembre 2023, le Compartiment Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE 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 USD
CLP	220 015 911	EUR	223 962	02/01/2024	4 541
CLP	3 727 422	GBP	3 300	02/01/2024	62
COP	2 185 230 522	EUR	511 804	02/01/2024	(1 289)
COP	31 932 896	GBP	6 495	02/01/2024	(37)
COP	114 618 671	USD	29 811	02/01/2024	(225)
EUR	223 962	CLP	220 015 911	02/01/2024	(4 541)
EUR	511 804	COP	2 185 230 522	02/01/2024	1 289
EUR	4 100 638	KRW	5 877 445 746	02/01/2024	(33 817)
EUR	1 563 898	MYR	8 021 394	02/01/2024	(18 119)
EUR	268 752	PEN	1 104 868	02/01/2024	(1 526)
GBP	3 300	CLP	3 727 422	02/01/2024	(62)
GBP	6 495	COP	31 932 896	02/01/2024	37
GBP	48 937	KRW	80 881 393	02/01/2024	(416)
GBP	19 854	MYR	117 425	02/01/2024	(246)
GBP	3 098	PEN	14 645	02/01/2024	(6)
KRW	5 877 445 746	EUR	4 100 639	02/01/2024	33 817
KRW	80 881 393	GBP	48 937	02/01/2024	416
KRW	340 772 742	USD	264 288	02/01/2024	307
MYR	8 021 394	EUR	1 563 899	02/01/2024	18 118
MYR	117 425	GBP	19 854	02/01/2024	245
MYR	467 075	USD	101 226	02/01/2024	423
PEN	1 104 868	EUR	268 752	02/01/2024	1 526
PEN	14 645	GBP	3 098	02/01/2024	6
PEN	57 952	USD	15 655	02/01/2024	(3)
USD	13 582	CLP	12 014 229	02/01/2024	0
USD	29 811	COP	114 618 671	02/01/2024	225
USD	264 288	KRW	340 772 742	02/01/2024	(308)
USD	101 226	MYR	467 075	02/01/2024	(423)
USD	15 655	PEN	57 952	02/01/2024	3
AUD	13 300	CHF	7 615	02/02/2024	9
AUD	65 700	EUR	40 579	02/02/2024	(4)
AUD	18 000	GBP	9 678	02/02/2024	(45)
CAD	23 600	CHF	14 930	02/02/2024	112
CAD	116 600	EUR	79 561	02/02/2024	473

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value/ (moins-value) latente USD
CAD	31 900	GBP	18 950	02/02/2024	41
CHF	1 502 809	AUD	2 601 862	02/02/2024	13 791
CHF	2 958 951	CAD	4 637 031	02/02/2024	8 176
CHF	63 980	CLP	67 180 977	02/02/2024	(548)
CHF	156 198	COP	719 697 186	02/02/2024	1 486
CHF	195 375	CZK	5 160 630	02/02/2024	2 144
CHF	275 246	DKK	2 191 310	02/02/2024	2 805
CHF	24 185 863	EUR	25 813 691	02/02/2024	273 711
CHF	4 430 552	GBP	4 113 003	02/02/2024	35 781
CHF	17 739	HKD	164 377	02/02/2024	74
CHF	91 399	HUF	37 522 562	02/02/2024	918
CHF	141 794	ILS	608 684	02/02/2024	(153)
CHF	11 553 251	JPY	1 938 864 740	02/02/2024	(45 033)
CHF	1 249 181	KRW	1 908 823 115	02/02/2024	4 080
CHF	91 320	NOK	1 090 620	02/02/2024	1 354
CHF	196 627	NZD	368 369	02/02/2024	1 063
CHF	80 326	PEN	354 016	02/02/2024	196
CHF	260 694	PLN	1 208 888	02/02/2024	3 363
CHF	114 446	RON	608 961	02/02/2024	1 211
CHF	493 945	SEK	5 806 172	02/02/2024	11 793
CHF	253 623	SGD	397 064	02/02/2024	828
CHF	48 067 993	USD	57 027 224	02/02/2024	255 840
COP	296 494 367	EUR	69 364	02/02/2024	(641)
CZK	29 000	CHF	1 085	02/02/2024	3
CZK	143 500	EUR	5 793	02/02/2024	8
CZK	39 300	GBP	1 381	02/02/2024	(4)
DKK	10 500	CHF	1 307	02/02/2024	1
DKK	51 800	EUR	6 952	02/02/2024	(1)
DKK	14 200	GBP	1 659	02/02/2024	(8)
EUR	4 210 235	AUD	6 828 191	02/02/2024	(7 459)
EUR	8 290 552	CAD	12 169 185	02/02/2024	(63 663)
EUR	1 584 798	CHF	1 483 932	02/02/2024	(15 730)
EUR	223 509	CLP	220 015 911	02/02/2024	(4 312)
EUR	506 016	COP	2 185 230 522	02/02/2024	(1 030)
EUR	551 113	CZK	13 640 688	02/02/2024	(243)
EUR	771 650	DKK	5 750 760	02/02/2024	(54)
EUR	12 584 133	GBP	10 940 665	02/02/2024	(32 059)
EUR	51 681	HKD	448 867	02/02/2024	(367)
EUR	258 776	HUF	99 602 907	02/02/2024	(492)
EUR	403 545	ILS	1 623 428	02/02/2024	(4 794)
EUR	32 732 814	JPY	5 148 125 266	02/02/2024	(476 537)
EUR	3 786 428	KRW	5 430 547 846	02/02/2024	(36 017)
EUR	255 833	NOK	2 863 285	02/02/2024	787
EUR	551 348	NZD	966 728	02/02/2024	(2 394)
EUR	268 563	PEN	1 104 868	02/02/2024	(1 129)
EUR	741 332	PLN	3 221 656	02/02/2024	917

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value/ (moins-value) latente USD
EUR	320 580	RON	1 598 555	02/02/2024	(297)
EUR	1 416 197	SEK	15 600 407	02/02/2024	16 376
EUR	660 215	SGD	967 990	02/02/2024	(4 655)
EUR	134 600 160	USD	149 659 304	02/02/2024	(798 132)
GBP	69 036	AUD	128 768	02/02/2024	71
GBP	135 947	CAD	229 490	02/02/2024	(778)
GBP	45 173	CHF	48 415	02/02/2024	(103)
GBP	3 293	CLP	3 727 422	02/02/2024	(63)
GBP	6 454	COP	31 932 896	02/02/2024	36
GBP	9 270	CZK	263 900	02/02/2024	23
GBP	12 300	DKK	105 425	02/02/2024	36
GBP	1 214 391	EUR	1 396 634	02/02/2024	3 760
GBP	830	HKD	8 295	02/02/2024	(5)
GBP	4 359	HUF	1 929 200	02/02/2024	4
GBP	6 762	ILS	31 288	02/02/2024	(73)
GBP	534 558	JPY	96 694 767	02/02/2024	(7 326)
GBP	58 146	KRW	95 795 460	02/02/2024	(368)
GBP	4 333	NOK	55 774	02/02/2024	29
GBP	8 226	NZD	16 594	02/02/2024	(19)
GBP	3 102	PEN	14 645	02/02/2024	4
GBP	12 309	PLN	61 523	02/02/2024	55
GBP	5 405	RON	31 000	02/02/2024	11
GBP	23 454	SEK	297 130	02/02/2024	384
GBP	11 019	SGD	18 579	02/02/2024	(55)
GBP	2 206 722	USD	2 822 323	02/02/2024	(8 732)
HKD	800	CHF	85	02/02/2024	1
HKD	4 000	EUR	461	02/02/2024	3
HKD	1 100	GBP	110	02/02/2024	0
HUF	214 200	CHF	516	02/02/2024	1
HUF	1 059 500	EUR	2 755	02/02/2024	3
HUF	289 900	GBP	656	02/02/2024	(2)
ILS	3 400	CHF	782	02/02/2024	12
ILS	16 900	EUR	4 195	02/02/2024	57
ILS	4 600	GBP	994	02/02/2024	11
JPY	9 979 500	CHF	59 326	02/02/2024	398
JPY	109 236 095	EUR	700 451	02/02/2024	3 589
JPY	14 246 999	GBP	79 531	02/02/2024	98
JPY	2 621 880	USD	18 694	02/02/2024	(14)
KRW	350 802 539	EUR	245 655	02/02/2024	1 156
KRW	20 996 511	USD	16 346	02/02/2024	(16)
NOK	6 200	CHF	510	02/02/2024	3
NOK	30 700	EUR	2 725	02/02/2024	12
NOK	8 400	GBP	649	02/02/2024	0
NZD	1 900	CHF	1 007	02/02/2024	3
NZD	9 300	EUR	5 318	02/02/2024	7
NZD	2 600	GBP	1 294	02/02/2024	(4)

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value/ (moins-value) latente USD
PLN	6 500	CHF	1 389	02/02/2024	(4)
PLN	32 300	EUR	7 448	02/02/2024	(26)
PLN	8 800	GBP	1 766	02/02/2024	(15)
RON	3 400	CHF	633	02/02/2024	0
RON	16 800	EUR	3 374	02/02/2024	(2)
RON	4 600	GBP	804	02/02/2024	(4)
SEK	31 100	CHF	2 610	02/02/2024	(20)
SEK	153 700	EUR	13 911	02/02/2024	(115)
SEK	42 100	GBP	3 317	02/02/2024	(47)
SGD	2 000	CHF	1 268	02/02/2024	7
SGD	10 100	EUR	6 910	02/02/2024	26
SGD	2 800	GBP	1 668	02/02/2024	(1)
USD	294 754	AUD	429 843	02/02/2024	1 165
USD	580 415	CAD	766 065	02/02/2024	(812)
USD	390 663	CHF	326 618	02/02/2024	1 419
USD	13 565	CLP	12 014 229	02/02/2024	(169)
USD	29 490	COP	114 618 671	02/02/2024	82
USD	38 684	CZK	860 934	02/02/2024	200
USD	52 453	DKK	351 505	02/02/2024	287
USD	6 175 242	EUR	5 553 821	02/02/2024	33 019
USD	1 261 339	GBP	986 622	02/02/2024	3 386
USD	3 554	HKD	27 753	02/02/2024	(3)
USD	18 156	HUF	6 278 566	02/02/2024	84
USD	28 183	ILS	101 958	02/02/2024	(147)
USD	2 283 459	JPY	322 933 906	02/02/2024	(17 256)
USD	264 198	KRW	340 772 742	02/02/2024	(839)
USD	18 031	NOK	181 453	02/02/2024	151
USD	38 598	NZD	60 857	02/02/2024	62
USD	15 675	PEN	57 952	02/02/2024	37
USD	51 798	PLN	202 331	02/02/2024	365
USD	22 602	RON	101 341	02/02/2024	107
USD	99 917	SEK	989 748	02/02/2024	1 589
USD	50 478	SGD	66 547	02/02/2024	(39)
CHF	482 076	MYR	2 646 663	05/02/2024	(2 574)
EUR	1 444 733	MYR	7 403 094	05/02/2024	(16 683)
GBP	22 247	MYR	130 985	05/02/2024	(205)
MYR	457 329	EUR	89 605	05/02/2024	637
MYR	29 830	USD	6 496	05/02/2024	10
USD	101 460	MYR	467 075	05/02/2024	(414)
Moins-value nette latente					(862 996)

Barclays Bank Ireland PLC, BNP Paribas SA, Goldman Sachs Bank Europe SE, HSBC Continental Europe, Morgan Stanley Bank AG, Royal Bank Of Canada (UK), Société Générale, State Street Bank International GmbH et UBS AG sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouverts.

Au 31 décembre 2023, le Compartiment Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF avait conclu les contrats de change à terme suivants :

7. Contrats de change à terme (suite)

Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Échéance	Plus-value/ (moins-value) latente EUR
EUR	966 488	AUD	1 567 481	02/02/2024	(1 563)
EUR	1 207 617	CAD	1 772 633	02/02/2024	(8 427)
EUR	216 500	DKK	1 613 489	02/02/2024	(15)
EUR	3 373 414	GBP	2 932 874	02/02/2024	(7 806)
EUR	61 177	ILS	246 141	02/02/2024	(666)
EUR	1 189 613	JPY	187 089 799	02/02/2024	(15 619)
EUR	173 864	NOK	1 945 879	02/02/2024	484
EUR	84 433	NZD	148 058	02/02/2024	(339)
EUR	110 478	SEK	1 217 244	02/02/2024	1 133
EUR	7 648 788	USD	8 504 538	02/02/2024	(41 057)
GBP	464 412	AUD	866 239	02/02/2024	431
GBP	580 306	CAD	979 612	02/02/2024	(3 006)
GBP	104 031	DKK	891 664	02/02/2024	280
GBP	4 989 762	EUR	5 739 379	02/02/2024	13 164
GBP	29 398	ILS	136 025	02/02/2024	(285)
GBP	570 410	JPY	103 178 570	02/02/2024	(7 069)
GBP	83 837	NOK	1 079 076	02/02/2024	507
GBP	40 578	NZD	81 822	02/02/2024	(67)
GBP	51 623	SEK	654 018	02/02/2024	765
GBP	3 673 725	USD	4 698 545	02/02/2024	(13 124)
USD	43 193	AUD	62 990	02/02/2024	154
USD	53 970	CAD	71 235	02/02/2024	(68)
USD	9 676	DKK	64 839	02/02/2024	48
USD	465 789	EUR	418 885	02/02/2024	2 283
USD	150 351	GBP	117 557	02/02/2024	420
USD	2 654	ILS	9 600	02/02/2024	(12)
USD	53 268	JPY	7 533 430	02/02/2024	(366)
USD	7 747	NOK	77 961	02/02/2024	59
USD	3 690	NZD	5 819	02/02/2024	4
USD	4 800	SEK	47 553	02/02/2024	69
Moins-value nette latente					(79 688)

Barclays Bank Ireland PLC, BNP Paribas SA, HSBC Continental Europe, Royal Bank Of Canada (UK), State Street Bank International GmbH et UBS AG sont les contreparties à ces contrats de change à terme ouverts.

8. Prêt de titres

Les Compartiments dotés d'une Politique d'investissement direct peuvent souscrire des opérations de prêt de titres (les « Opérations de prêt de titres ») pouvant représenter jusqu'à 100 % 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.

Selon la valeur des Opérations de prêt de titres et de la politique choisie, un Compartiment peut à tout moment être exposé, en totalité ou en partie, à une ou plusieurs contrepartie(s), auquel cas il convient de souscrire à une garantie adaptée ou de prendre d'autres dispositions (conformes aux Réglementations) destinées à atténuer le risque de contrepartie, et/ou un paiement sera reçu des contreparties des Opérations de prêt de titres de telle manière que le pourcentage d'exposition au risque de contrepartie reste dans les limites fixées par les Réglementations.

Pour les Compartiments autorisés à conclure des Opérations de prêt de titres comme décrit dans l'Annexe produit correspondante, le Gestionnaire d'investissement, DWS Investment GmbH, 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 garantie en vertu de ces Opérations de prêt de titres, conformément et dans les limites prévues séparément par les règles figurant dans le Prospectus et dans les Réglementations.

Les revenus bruts générés par les Opérations de prêt de titres (minorés de tous les frais et toutes les commissions directs ou indirects applicables encourus et versés à la Société de gestion, au Gestionnaire d'investissement et aux autres prestataires de services concernés, tels que décrits plus en détail dans l'Annexe produit correspondante) seront reversés au Compartiment correspondant. Chaque Compartiment a conservé 70 % des revenus bruts générés par les Opérations de prêt de titres. La Société de gestion a perçu 30 % des revenus bruts générés par les prêts. Des 30 % des revenus bruts qu'elle perçoit, la Société de gestion en conserve 5 % (soit 1,5 % du total des revenus bruts générés par ces transactions) pour ses propres tâches de coordination et de supervision et indemnise les fournisseurs de services externes à hauteur de leurs coûts directs (coûts liés à la gestion des transactions et des garanties, par exemple). Le montant restant (après déduction des coûts engrangés par la Société de gestion et des coûts directs) est versé au Gestionnaire d'investissement pour appuyer la Société de gestion dans l'engagement, la préparation et la mise en œuvre des Opérations de prêt de titres.

Toutes les Opérations de prêt de titres sont réglées de manière bilatérale.

Sur l'exercice clos le 31 décembre 2023, les Compartiments suivants ont rapporté des revenus nets issus du prêt de titres :

- 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
- 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
- Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF
- Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF
- Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF
- Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF
- Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF
- Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF
- Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF
- Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF
- Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF
- Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

8. Prêt de titres (suite)

- Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF
- Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF
- Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF

Les valeurs de marché des titres prêtés indiquées dans les tableaux ci-dessous peuvent s'écarter de l'évaluation de marché des titres du portefeuille des compartiments en raison d'une méthode de tarification différente (sale ou propre) utilisée par l'Agent de prêt de titres et l'Agent administratif dans la VL. La valeur des titres prêtés et la valeur de marché des garanties en numéraire et des garanties non-numéraires reçues pour chaque Compartiment au 31 décembre 2023 sont détaillées dans le tableau suivant :

Compartiment	Devise du Compartiment	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023 (en EUR)	Valeur de marché des garanties reçues au 31 décembre 2023 (en EUR)	Garanties en pourcentage de la valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	1 156 149 512	1 212 190 509	104,85 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	770 204 011	806 453 446	104,71 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	93 091 138	98 252 186	105,54 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	186 535 920	195 585 645	104,85 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	463 587 659	485 796 378	104,79 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	EUR	6 776 594	7 161 183	105,68 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	38 580 754	40 641 758	105,34 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	503 794 246	529 053 630	105,01 %
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	227 938 591	242 279 174	106,29 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	USD	16 436 211	17 766 303	108,09 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	391 714 893	410 868 180	104,89 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	1 206 158 151	1 263 697 937	104,77 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	135 595 274	145 792 407	107,52 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	661 021 680	698 457 066	105,66 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	21 126 467	22 581 511	106,89 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	427 923 036	449 357 405	105,01 %
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	AUD	2 713 443	2 839 731	104,65 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	395 499 307	414 477 426	104,80 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	67 201 394	70 528 782	104,95 %

Les développements suivants résument la valeur des titres prêtés et des garanties connexes reçues, analysée pour chaque contrepartie à l'opération d'emprunt, au 31 décembre 2023 :

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

8. Prêt de titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés (en EUR)	Valeur de marché de la garantie non-numéraire reçue (en EUR)	% de l'actif net
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	62 528 878	65 622 822	2,09 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	133 564 386	139 740 586	4,46 %
		BNP Paribas SA	France	204 765	295 284	0,01 %
		BofA Securities Europe SA	France	60 540 322	63 773 901	2,02 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	230 935 294	242 122 068	7,71 %
		DekaBank Deutsche Girozentrale	Allemagne	3 972 489	4 162 318	0,13 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	213 619 666	224 339 548	7,13 %
		Société Générale SA	France	72 420 197	75 881 086	2,42 %
		UBS AG	Royaume-Uni	153 375 894	160 705 398	5,12 %
		UniCredit Bank AG	Allemagne	34 722 964	36 196 042	1,16 %
		Zürcher Kantonalbank	Suisse	190 264 657	199 351 456	6,35 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	23 150 405	24 256 604	1,29 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	132 720 354	138 680 986	7,39 %
		BofA Securities Europe SA	France	37 354 471	39 222 539	2,08 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	96 471 790	101 528 744	5,37 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	51 277 680	53 809 900	2,85 %
		Société Générale SA	France	149 526 001	156 322 372	8,33 %
		Zürcher Kantonalbank	Suisse	279 703 310	292 632 301	15,58 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	BNP Paribas Arbitrage	France	1 667 523	1 743 603	0,48 %
		BofA Securities Europe SA	France	8 568 976	8 993 405	2,48 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	7 224 574	7 944 850	2,09 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	5 885 376	6 349 161	1,71 %
		UBS AG	Royaume-Uni	12 751 648	13 361 084	3,69 %
		Zürcher Kantonalbank	Suisse	56 993 041	59 860 083	16,50 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	16 965 848	17 776 567	2,82 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	6 433 930	6 732 911	1,07 %
		BofA Securities Europe SA	France	17 408 352	18 216 873	2,90 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	41 836 495	43 930 827	6,96 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	30 728 874	32 301 452	5,12 %
		Société Générale SA	France	13 582 138	14 199 515	2,26 %
		UBS AG	Royaume-Uni	15 858 000	16 615 847	2,64 %
		Zürcher Kantonalbank	Suisse	43 722 283	45 811 653	7,28 %

8. Prêt de titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés (en EUR)	Valeur de marché de la garantie non-numéraire reçue (en EUR)	% de l'actif net
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	64 667 104	67 757 302	6,99 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	168 976 267	177 051 421	18,25 %
		BofA Securities Europe SA	France	21 212 564	22 237 946	2,29 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	121 866 959	127 792 052	13,17 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	33 719 533	35 272 693	3,64 %
		Société Générale SA	France	30 674 933	32 140 822	3,31 %
		UBS AG	Royaume-Uni	5 017 800	5 257 595	0,54 %
		Zürcher Kantonalbank	Suisse	17 452 499	18 286 547	1,89 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	EUR	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	2 462 003	2 551 005	4,77 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	4 314 591	4 610 178	8,35 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	BofA Securities Europe SA	France	7 304 824	7 708 001	5,82 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	6 651 146	6 971 812	5,30 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	10 951 201	11 634 915	8,73 %
		Société Générale SA	France	7 611 994	7 975 755	6,07 %
		UBS AG	Royaume-Uni	6 061 589	6 351 275	4,83 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	BNP Paribas Arbitrage	France	54 214 394	56 710 911	4,76 %
		BofA Securities Europe SA	France	1 649 362	1 732 124	0,14 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	75 615 706	79 504 172	6,64 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	9 450 162	9 948 372	0,83 %
		Natixis SA	Allemagne	26 917 798	28 204 233	2,36 %
		Société Générale SA	France	6 820 187	7 130 192	0,60 %
		UBS AG	Royaume-Uni	281 883 696	295 354 232	24,74 %
		UniCredit Bank AG	Allemagne	4 060 263	4 360 176	0,36 %
Zürcher Kantonalbank	Suisse	43 182 678	46 109 218	3,79 %		
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	BofA Securities Europe SA	France	4 948 086	8 556 682	0,97 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	37 679 440	39 555 600	7,37 %
		UBS AG	Royaume-Uni	87 767 539	91 961 889	17,18 %
		Zürcher Kantonalbank	Suisse	97 543 526	102 205 003	19,09 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	USD	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	1 008 511	1 058 596	0,31 %
		BNP Paribas SA	France	680 161	982 542	0,21 %
		BofA Securities Europe SA	France	88 690	185 885	0,03 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	14 658 849	15 539 280	4,55 %

8. Prêt de titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés (en EUR)	Valeur de marché de la garantie non-numéraire reçue (en EUR)	% de l'actif net
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	47 284 992	49 579 287	1,94 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	128 950 570	134 830 138	5,28 %
		BofA Securities Europe SA	France	13 613 278	14 288 203	0,56 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	96 308 294	101 130 696	3,94 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	39 198 757	41 120 072	1,60 %
		UBS AG	Royaume-Uni	51 908 425	54 389 043	2,13 %
		Zürcher Kantonalbank	Suisse	14 450 577	15 530 741	0,59 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	142 000 361	148 784 040	5,02 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	64 042 409	67 004 677	2,27 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	86 031 706	90 143 090	3,04 %
		Natixis SA	Allemagne	150 911 298	158 123 241	5,34 %
		Société Générale SA	France	329 796 872	345 557 288	11,66 %
		UBS AG	Royaume-Uni	433 375 505	454 085 601	15,32 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	36 856 281	40 449 157	0,95 %
		BNP Paribas SA	France	24 976 787	26 379 099	0,65 %
		BofA Securities Europe SA	France	2 840 361	2 977 933	0,07 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	28 227 741	30 537 496	0,73 %
		DekaBank Deutsche Girozentrale	Allemagne	7 412 483	7 766 707	0,19 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	15 766 817	16 527 156	0,41 %
		Goldman Sachs Bank Europe SE	Allemagne	18 903 571	20 514 415	0,49 %
		UBS AG	Royaume-Uni	611 233	640 444	0,02 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	10 369 655	10 865 204	0,81 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	68 702 601	71 985 834	5,38 %
		BofA Securities Europe SA	France	117 681 587	128 688 438	9,21 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	71 276 078	75 024 275	5,58 %
		DekaBank Deutsche Girozentrale	Allemagne	17 082 525	17 898 844	1,34 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	43 347 959	45 493 250	3,39 %
		Société Générale SA	France	142 715 346	149 535 569	11,17 %
		UBS AG	Royaume-Uni	3 482 840	3 649 282	0,27 %
		UniCredit Bank AG	Allemagne	17 323 320	18 198 473	1,36 %
		Zürcher Kantonalbank	Suisse	169 039 769	177 117 897	13,24 %

8. Prêt de titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés (en EUR)	Valeur de marché de la garantie non-numéraire reçue (en EUR)	% de l'actif net
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	BNP Paribas Arbitrage	France	978 378	1 025 136	2,45 %
		BofA Securities Europe SA	France	6 337 242	6 633 811	15,86 %
		Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	France	2 267 605	2 827 680	5,68 %
		DekaBank Deutsche Girozentrale	Allemagne	2 952 932	3 094 056	7,39 %
		Société Générale SA	France	8 590 310	9 000 828	21,51 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	140 672 754	147 395 177	15,24 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	19 063 878	19 974 870	2,06 %
		BofA Securities Europe SA	France	9 007 391	9 446 440	0,97 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	137 442 145	144 986 450	14,89 %
		Société Générale SA	France	121 736 868	127 554 468	13,19 %
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	AUD	BNP Paribas Arbitrage	France	2 713 443	2 839 731	10,48 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	103 335 885	108 259 565	19,86 %
		BNP Paribas Arbitrage	France	10 216 646	10 704 836	1,96 %
		BofA Securities Europe SA	France	7 567 919	7 915 872	1,45 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	29 318 233	30 825 339	5,64 %
		Société Générale SA	France	245 060 624	256 771 814	47,11 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	Barclays Bank Ireland PLC	Irlande	20 474 808	21 581 936	1,52 %
		BNP Paribas SA	France	12 752 466	13 358 469	0,95 %
		BofA Securities Europe SA	France	1 045 680	1 093 844	0,08 %
		Deutsche Bank AG	Allemagne	3 618 427	3 783 820	0,27 %
		Goldman Sachs Bank Europe SE	Allemagne	28 153 476	29 498 890	2,09 %
		UBS AG	Royaume-Uni	1 156 537	1 211 823	0,09 %

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

8. Prêt de titres (suite)

Pour tous les Compartiments, la durée d'échéance des titres faisant l'objet du prêt est ouverte car ceux-ci consistent exclusivement en des actions. Pour connaître la durée d'échéance des garanties reçues, veuillez consulter la Note 9.2.

Pour connaître la valeur de marché des titres en prêt selon la durée d'échéance, veuillez consulter la Note 9.2.

Le tableau qui suit récapitule la valeur des garanties reçues (analysées par devise) au 31 décembre 2023 :

Compartiment	Devise du Compartiment	Devise du titre	Garantie non-numéraire reçue (en EUR)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	AUD	16 056 704
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CAD	11 498 995
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CHF	55 737 550
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	DKK	23 427 476
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	EUR	732 466 372
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	GBP	76 580 176
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	JPY	160 499 559
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	NOK	54
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	SEK	41
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	USD	135 923 582
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	AUD	5 810 932
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	CAD	8 950 367
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	CHF	89 770 848
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	DKK	13 983 657
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	EUR	412 670 900
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	GBP	90 264 016
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	JPY	122 707 340
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	NOK	5 303
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	SEK	9 834 862
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	USD	52 455 221
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	AUD	1 307 446
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	CAD	1 577 756
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	CHF	5 396 946
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	DKK	25 970
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	EUR	39 219 174
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	GBP	11 428 076
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	JPY	30 314 461
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	EUR	USD	8 982 357
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	AUD	4 144 834
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	CAD	1 506 527
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	DKK	2 005 316
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	EUR	114 339 477
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	GBP	18 174 280
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	JPY	27 825 946
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	NOK	16
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	SEK	1 950 553
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	EUR	USD	25 638 696
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	AUD	2 791 451
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	CHF	7 603 458
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	DKK	10 680 403
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	EUR	312 577 215

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

8. Prêt de titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Devise du titre	Garantie non-numéraire reçue (en EUR)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	GBP	14 483 198
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	JPY	33 344 870
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	NOK	4 295 661
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	NZD	435 848
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	SEK	6 130 394
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	EUR	USD	93 453 880
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	EUR	EUR	7 161 183
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	AUD	2 114 971
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	EUR	28 893 478
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	GBP	302 948
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	JPY	4 054 324
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	NZD	125 903
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	EUR	USD	5 150 134
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	AUD	7
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	CAD	12 650 772
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	CHF	6 981 357
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	DKK	20 771 693
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	EUR	207 378 858
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	GBP	41 719 132
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	JPY	111 102 445
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	SEK	62 815
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	USD	128 386 551
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	AUD	5 237 866
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	CAD	966 686
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	CHF	27 731 661
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	DKK	3 930 808
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	EUR	54 248 893
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	GBP	36 066 684
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	JPY	28 803 636
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	NOK	62 429
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	NZD	6 705 468
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	SEK	7 378 351
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	EUR	USD	71 146 692
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	USD	EUR	17 694 933
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	USD	GBP	54 041
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	USD	USD	17 329
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	AUD	6 821 936
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CAD	3 026 901
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CHF	5 161 140
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	DKK	5 695 407
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	EUR	257 206 870
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	GBP	35 275 834
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	JPY	14 898 327
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	NOK	13 147 848
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	NZD	3 752 176
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	USD	65 881 741

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

8. Prêt de titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Devise du titre	Garantie non-numéraire reçue (en EUR)
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	AUD	17 728 275
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	CAD	45 267 067
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	CHF	34 489 103
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	DKK	355 372
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	EUR	360 541 305
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	GBP	108 768 216
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	JPY	343 575 846
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	NOK	18 296 299
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	NZD	501 906
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	SEK	7 582 462
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	USD	326 592 086
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	CAD	57 929
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	CHF	702 673
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	DKK	702 683
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	EUR	134 817 602
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	GBP	5 021 006
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	JPY	428 015
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	USD	4 062 499
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	AUD	20 239 442
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CAD	929 867
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	CHF	16 023 929
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	DKK	19 447 818
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	EUR	442 812 926
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	GBP	42 504 743
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	JPY	91 849 677
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	SEK	21
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	USD	64 648 643
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	AUD	202 651
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	CAD	667 126
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	DKK	279 926
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	EUR	12 978 087
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	GBP	1 398 390
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	JPY	4 675 083
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	USD	2 380 248
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	AUD	5 331 377
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	CAD	1 719 432
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	DKK	21 640
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	EUR	324 774 343
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	GBP	13 494 438
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	JPY	71 152 090
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	EUR	USD	32 864 085
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	AUD	EUR	2 001 041
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	AUD	GBP	67 341
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	AUD	JPY	257 217
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	AUD	USD	514 132

8. Prêt de titres (suite)

Compartiment	Devise du Compartiment	Devise du titre	Garantie non-numéraire reçue (en EUR)
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	AUD	2 062 681
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	CHF	13 667 337
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	DKK	1 274 111
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	EUR	161 957 382
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	GBP	17 896 828
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	JPY	177 440 598
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	NOK	5 900 248
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	NZD	23
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	EUR	USD	34 278 218
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	CAD	108 786
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	EUR	67 797 207
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	GBP	718 268
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	USD	1 904 521

9. Garantie**9.1 Garantie reçue au regard d'opérations 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 négociés 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 négociés 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 31 décembre 2023 :

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 Londres	Royaume-Uni	75 407 479	0	1,58 %
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG Londres	Royaume-Uni	787 490	0	3,13 %
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	USD	Deutsche Bank AG Londres	Royaume-Uni	2 702 077	0	1,04%

9. Garantie (suite)

9.1 Garantie reçue au regard d'opérations 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 GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	GBP	Deutsche Bank AG Londres	Royaume-Uni	836 552	0	1,35 %
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	EUR	Deutsche Bank AG Londres	Royaume-Uni	424 481	0	0,77 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	EUR	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	0	1 230 000	1,41 %

Le tableau suivant présente une analyse par devise des garanties en numéraire et des garanties non-numéraires sous-jacentes reçues/mises en nantissement, au 31 décembre 2023 :

Compartiments	Devise de l'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	DKK	114	0
	EUR	58 858 544	0
	USD	16 548 821	0
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	DKK	787 490	0
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	DKK	16 713	0
	EUR	2 685 364	0
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	EUR	836 552	0
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	EUR	424 481	0
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	EUR	0	1 230 000

Au 31 décembre 2023, aucune des garanties en numéraire reçues au titre des opérations de swap n'est réutilisée.

Le Dépositaire 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 ci-dessous reprend la valeur des garanties en numéraire et des garanties non-numéraires reçues/mises en nantissement par type d'instruments et par notation pour les obligations, au 31 décembre 2023 :

Type de garantie	Notation	Garantie non-numéraire mise en nantissement (en EUR)	Garantie en numéraire reçue (en EUR)
Liquidités	S/O	0	1 230 000

9. Garantie (suite)**9.1 Garantie reçue au regard d'opérations de swap (suite)**

Type de garantie	Notation	Garantie non-numéraire mise en nantissement (en EUR)	Garantie en numéraire reçue (en EUR)
Obligations	AAA	17 353 138	0
Obligations	A+	498 515	0
Obligations	A	41 939 839	0
Obligations	BBB-	920	0
Obligations	BB+	20 365 667	0

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 opérations de swap, au 31 décembre 2023 :

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 EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	EUR	Plus de 365 jours	75 407 479	0
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	EUR	Plus de 365 jours	787 490	0
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	USD	Plus de 365 jours	2 702 077	0
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	GBP	Plus de 365 jours	836 552	0
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	EUR	Plus de 365 jours	424 481	0
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	EUR	Opérations ouvertes	0	1 230 000

Le tableau suivant répertorie les 10 plus grands émetteurs par valeur de garantie non-numéraire mise en nantissement par les Compartiments au regard des opérations de swap, au 31 décembre 2023 :

Compartiments	Type de garantie	Émetteur de la garantie	Garantie non-numéraire mise en nantissement (dans la devise du Compartiment)
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Revenu fixe	UBS Group AG	30 397 909
	Revenu fixe	Obligations d'État de Grèce	19 105 554
	Revenu fixe	CPPIB Capital Inc.	16 548 821
	Revenu fixe	Santander Consumer Finance SA	9 355 081
	Revenu fixe	Realkredit Danmark A/S	114
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	Revenu fixe	Realkredit Danmark A/S	787 490

9. Garantie (suite)

9.1 Garantie reçue au regard d'opérations de swap (suite)

Compartiments	Type de garantie	Émetteur de la garantie	Garantie non-numéraire mise en nantissement (dans la devise du Compartiment)
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Revenu fixe	Santander Consumer Finance SA	2 186 849
	Revenu fixe	Banco Santander SA	498 515
	Revenu fixe	Nykredit Realkredit AS	16 713
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Revenu fixe	Obligations d'État de Grèce	836 552
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	Revenu fixe	Obligations d'État de Grèce	424 481

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 31 décembre 2023 :

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	-	998 046
	31 à 90 jours	-	1 086 138
	91 à 365 jours	6 107 030	13 351 601
	Plus de 365 jours	1 150 042 482	447 562 599
	Opérations ouvertes	-	749 192 125
	Total	1 156 149 512	1 212 190 509
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	91 à 365 jours	52 251 306	4 051 566
	Plus de 365 jours	717 952 705	169 197 276
	Opérations ouvertes	-	633 204 604
	Total	770 204 011	806 453 446
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	31 à 90 jours	-	790 787
	91 à 365 jours	-	845 819
	Plus de 365 jours	93 091 138	25 077 537
	Opérations ouvertes	-	71 538 043
	Total	93 091 138	98 252 186
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	91 à 365 jours	-	1 680 384
	Plus de 365 jours	186 535 920	72 381 133
	Opérations ouvertes	-	121 524 128
	Total	186 535 920	195 585 645
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	31 à 90 jours	-	3 699 925
	91 à 365 jours	-	2 800 274
	Plus de 365 jours	463 587 659	131 323 744
	Opérations ouvertes	-	347 972 435
	Total	463 587 659	485 796 378
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	Plus de 365 jours	6 776 594	7 161 183
	Total	6 776 594	7 161 183

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 EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	91 à 365 jours	-	215 467
	Plus de 365 jours	38 580 754	23 009 595
	Opérations ouvertes	-	17 416 696
	Total	38 580 754	40 641 758
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	91 à 365 jours	-	155 325
	Plus de 365 jours	503 794 246	24 804 980
	Opérations ouvertes	-	504 093 325
	Total	503 794 246	529 053 630
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	91 à 365 jours	-	767 741
	Plus de 365 jours	227 938 591	10 966 881
	Opérations ouvertes	-	230 544 552
	Total	227 938 591	242 279 174
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	8 à 30 jours	-	6 375
	91 à 365 jours	-	20 813
	Plus de 365 jours	16 436 211	17 739 115
	Total	16 436 211	17 766 303
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	31 à 90 jours	-	892 332
	91 à 365 jours	2 170 383	1 434 931
	Plus de 365 jours	389 544 510	119 852 996
	Opérations ouvertes	-	288 687 921
	Total	391 714 893	410 868 180
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	91 à 365 jours	12 205 635	-
	Plus de 365 jours	1 193 952 516	6 111 360
	Opérations ouvertes	-	1 257 586 577
	Total	1 206 158 151	1 263 697 937
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	8 à 30 jours	-	293 923
	31 à 90 jours	-	388 451
	91 à 365 jours	1 362 987	5 418 013
	Plus de 365 jours	133 949 892	112 604 219
	Opérations ouvertes	282 395	27 087 801
	Total	135 595 274	145 792 407
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	8 à 30 jours	-	80 931
	31 à 90 jours	-	1 479 800
	91 à 365 jours	2 979 367	5 943 867
	Plus de 365 jours	658 042 313	231 198 195
	Opérations ouvertes	-	459 754 273
	Total	661 021 680	698 457 066
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	31 à 90 jours	-	593 090
	91 à 365 jours	993 122	598 493
	Plus de 365 jours	20 133 345	8 269 907
	Opérations ouvertes	-	13 120 021
	Total	21 126 467	22 581 511

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 IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	31 à 90 jours	-	734 174
	91 à 365 jours	4 366 107	850 845
	Plus de 365 jours	423 556 929	152 847 871
	Opérations ouvertes	-	294 924 515
	Total	427 923 036	449 357 405
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Plus de 365 jours	2 713 443	202 792
	Opérations ouvertes	-	2 636 939
	Total	2 713 443	2 839 731
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	31 à 90 jours	-	538 275
	91 à 365 jours	11 448 903	714 092
	Plus de 365 jours	384 050 404	44 781 622
	Opérations ouvertes	-	368 443 437
	Total	395 499 307	414 477 426
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	8 à 30 jours	-	31 158
	91 à 365 jours	99 097	573 918
	Plus de 365 jours	67 102 297	39 212 993
	Opérations ouvertes	-	30 710 713
	Total	67 201 394	70 528 782

Le tableau suivant répertorie les 10 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 31 décembre 2023 :

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 d'Espagne	213 107 048	7,12 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	94 989 661	3,17 %
	Action	JSR Corp.	20 639 876	0,69 %
	Action	Banco Santander SA	17 772 776	0,59 %
	Action	Kakaku.com Inc.	17 772 738	0,59 %
	Action	Toyo Suisan Kaisha Ltd.	17 772 727	0,59 %
	Action	Partners Group Holding AG	17 769 984	0,59 %
	Action	Givaudan SA	17 766 644	0,59 %
	Action	Holcim Ltd.	17 238 921	0,58 %
	Action	ENEL SpA	16 151 999	0,54 %

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'Espagne	53 090 646	2,96 %
	Action	UniCredit SpA	26 756 877	1,49 %
	Action	The British Land Co. PLC	26 515 822	1,48 %
	Action	Banco Santander SA	26 515 804	1,48 %
	Action	Novartis AG	26 515 688	1,48 %
	Revenu fixe	Kommuninvest i Sverige AB	26 077 686	1,45 %
	Action	Taisho Pharmaceutical Holdings Co. Ltd.	24 433 770	1,36 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	20 132 832	1,12 %
	Action	ABB Ltd.	15 550 630	0,87 %
	Action	Sohgo Security Services Co. Ltd.	15 083 257	0,84 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	8 732 228	2,53 %
	Revenu fixe	Obligation d'état d'Allemagne	7 157 806	2,07 %
	Action	Park24 Co. Ltd.	5 402 933	1,56 %
	Action	Lawson Inc.	5 402 898	1,56 %
	Action	Banco Santander SA	5 402 854	1,56 %
	Action	Unibail-Rodamco-Westfield SE	5 402 090	1,56 %
	Action	Givaudan SA	5 396 946	1,56 %
	Action	Kakaku.com Inc.	5 185 519	1,50 %
	Action	Benesse Holdings Inc.	4 483 217	1,30 %
	Action	Fuji Corp.	4 371 787	1,27 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Espagne	24 549 694	4,09 %
	Revenu fixe	Barclays Bank PLC	17 715 166	2,95 %
	Revenu fixe	Obligation d'état d'Allemagne	9 396 165	1,56 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	5 382 902	0,90 %
	Action	Tritax Big Box REIT PLC	4 144 849	0,69 %
	Action	The British Land Co. PLC	4 144 846	0,69 %
	Action	Ibiden Co. Ltd.	4 144 842	0,69 %
	Action	Kakaku.com Inc.	4 144 841	0,69 %
	Action	Steadfast Group Ltd.	4 144 834	0,69 %
	Action	Banco Santander SA	4 446 909	0,74 %

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 7-10 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	44 212 018	4,78 %
	Action	ENEL SpA	22 149 196	2,39 %
	Action	Industria de Diseño Textil SA	22 149 109	2,39 %
	Revenu fixe	Obligation d'état d'Allemagne	20 146 510	2,18 %
	Action	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	17 673 208	1,91 %
	Action	Anheuser-Busch InBev SA/NV	16 018 871	1,73 %
	Action	Repsol SA	16 018 837	1,73 %
	Action	Microsoft Corp.	16 018 781	1,73 %
	Action	Meta Platforms Inc.	16 018 633	1,73 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15- 30 UCITS ETF	Action	Tesla Inc.	15 411 471	1,66 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Espagne	2 328 848	4,51 %
	Revenu fixe	International Development Association	2 281 329	4,42 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	2 551 006	4,94 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Espagne	7 195 783	5,74 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	4 569 044	3,64 %
	Revenu fixe	International Development Association	4 005 798	3,19 %
	Revenu fixe	Vonovia Finance BV	733 874	0,58 %
	Action	Kemira Oy	721 611	0,58 %
	Action	Cousins Properties Inc.	721 593	0,58 %
	Action	Gecina SA	721 574	0,58 %
	Action	Welltower Inc.	721 564	0,58 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Action	Marr SpA	719 327	0,57 %
	Action	UniCredit SpA	715 604	0,57 %
	Action	JSR Corp.	27 368 835	2,40 %
	Action	TUI AG	26 722 521	2,35 %
	Action	Hitachi Ltd.	26 722 494	2,35 %
	Action	Symrise AG	26 722 474	2,35 %
	Action	Wolfspeed Inc.	21 084 736	1,85 %
	Action	Welltower Inc.	19 604 929	1,72 %
	Action	Fortune Brands Innovations Inc.	18 578 238	1,63 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Action	Descente Ltd.	14 017 766	1,23 %
	Action	Weyerhaeuser Co.	13 517 679	1,19 %
	Action	Shaftesbury Capital PLC	12 668 563	1,11 %

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 INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Action	Benesse Holdings Inc.	9 247 081	1,81 %
	Action	Banco Santander SA	9 247 058	1,81 %
	Action	Unibail-Rodamco-Westfield SE	9 246 155	1,81 %
	Action	Holcim Ltd.	9 245 990	1,81 %
	Action	Partners Group Holding AG	9 245 388	1,81 %
	Action	Givaudan SA	9 240 283	1,81 %
	Action	Mid-America Apartment Communities Inc.	8 320 360	1,63 %
	Action	BellRing Brands Inc.	8 320 325	1,63 %
	Action	Lumen Technologies Inc.	8 320 262	1,63 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de Slovaquie	5 008 318	1,56 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Estonie	2 810 510	0,87 %
	Revenu fixe	Islandsbanki hf.	2 469 394	0,77 %
	Revenu fixe	TenneT Holding BV	1 151 302	0,36 %
	Revenu fixe	Thales SA	1 148 825	0,36 %
	Revenu fixe	Edenred SE	1 146 338	0,36 %
	Revenu fixe	Obligation d'état d'Allemagne	1 128 974	0,35 %
	Revenu fixe	Bpifrance SACA	1 069 243	0,33 %
	Revenu fixe	International Development Association	546 955	0,17 %
	Revenu fixe	Siemens Financieringsmaatschappij NV	301 027	0,09 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	40 647 259	1,66 %
	Revenu fixe	Obligation d'État d'Espagne	34 765 125	1,42 %
	Action	Kion Group AG	12 224 462	0,50 %
	Revenu fixe	Compagnie de Financement Foncier	11 578 253	0,47 %
	Action	Assicurazioni Generali SpA	11 324 338	0,46 %
	Action	Scout24 SE	10 602 123	0,43 %
	Action	Var Energi ASA	9 536 833	0,39 %
	Action	A2A SpA	7 964 883	0,33 %
	Revenu fixe	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	7 503 302	0,31 %
Action	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	7 221 066	0,30 %	

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 US TREASURIES UCITS ETF	Action	Ferrovial SE	41 083 673	1,45 %
	Action	JSR Corp.	40 898 210	1,45 %
	Action	TeamViewer SE	34 682 408	1,23 %
	Action	FTI Consulting Inc.	34 666 214	1,23 %
	Action	Public Storage	33 815 131	1,20 %
	Action	Exelixis Inc.	33 271 170	1,18 %
	Action	USS Co. Ltd.	31 920 039	1,13 %
	Action	Japan Post Insurance Co. Ltd.	26 869 115	0,95 %
	Action	Mitsubishi HC Capital Inc.	24 621 818	0,87 %
	Action	Healthpeak Properties Inc.	21 398 887	0,76 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'état d'Allemagne	16 381 418	0,42 %
	Revenu fixe	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	15 232 440	0,39 %
	Revenu fixe	Novo Banco SA	11 262 520	0,29 %
	Revenu fixe	The Bank of Nova Scotia	6 780 301	0,18 %
	Revenu fixe	Obligation d'état d'Allemagne	4 775 257	0,12 %
	Revenu fixe	Banque européenne d'investissement (BEI)	4 327 398	0,11 %
	Revenu fixe	Mécanisme européen de stabilité (MES)	3 631 931	0,09 %
	Revenu fixe	Agence française de développement	3 616 157	0,09 %
	Revenu fixe	Bpifrance SACA	3 544 205	0,09 %
	Revenu fixe	Obligation d'État de Belgique	3 362 989	0,09 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État de France OAT	46 306 459	3,63 %
	Revenu fixe	Obligation d'état d'Allemagne	44 553 606	3,49 %
	Action	Banco de Sabadell SA	23 561 230	1,84 %
	Action	UniCredit SpA	16 125 658	1,26 %
	Action	Fancl Corp.	16 024 921	1,25 %
	Action	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	16 024 911	1,25 %
	Action	Toyo Suisan Kaisha Ltd.	16 024 877	1,25 %
	Action	Banco Santander SA	16 024 872	1,25 %
	Action	Swisscom AG	16 023 929	1,25 %
Action	Christian Hansen Holding AS	14 512 243	1,14 %	

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 OAT	3 407 707	8,53 %
	Action	Tsugami Corp.	814 357	2,04 %
	Action	Relo Group Inc.	814 356	2,04 %
	Action	Intervest Offices & Warehouses SA	814 348	2,04 %
	Action	NSD Co. Ltd.	814 348	2,04 %
	Action	Belc Co. Ltd.	814 341	2,04 %
	Action	JSR Corp.	814 269	2,04 %
	Action	UniCredit SpA	814 203	2,04 %
	Action	Mapfre SA	807 777	2,02 %
	Action	Shurgard Self Storage Ltd.	725 461	1,82 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Espagne	144 986 450	15,71 %
	Action	Gecina SA	13 335 729	1,44 %
	Action	Ferrovial SE	13 335 728	1,44 %
	Action	Euronext NV	13 335 728	1,44 %
	Action	Repsol SA	13 335 702	1,44 %
	Action	Industria de Diseño Textil SA	13 335 683	1,44 %
	Action	SAP SE	13 335 678	1,44 %
	Action	QUALCOMM Inc.	13 335 659	1,44 %
	Action	UniCredit SpA	11 540 641	1,25 %
	Action	Nihon M&A Center Holdings Inc.	11 540 635	1,25 %
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Action	Ströer SE & Co. KGaA	257 233	0,99 %
	Action	Repsol SA	257 231	0,99 %
	Action	Grafton Group PLC	257 228	0,99 %
	Action	Cosmo Energy Holdings Co. Ltd.	257 217	0,99 %
	Action	Broadcom Inc.	257 179	0,99 %
	Action	Imcd NV	257 169	0,99 %
	Action	UniCredit SpA	257 158	0,99 %
	Action	ENEL SpA	257 083	0,99 %
	Action	Microsoft Corp.	256 953	0,99 %
	Revenu fixe	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	202 792	0,78 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'État d'Espagne	30 825 339	5,93 %
	Action	UniCredit SpA	24 200 191	4,65 %
	Action	Lawson Inc.	21 345 474	4,10 %
	Action	JSR Corp.	17 867 662	3,43 %
	Action	LIXIL Corp.	16 034 794	3,08 %
	Action	Mitsubishi HC Capital Inc.	15 832 038	3,04 %
	Action	TIS Inc.	15 417 760	2,96 %
	Action	Sika AG	13 667 337	2,63 %
	Action	Cousins Properties Inc.	13 667 177	2,63 %
	Action	Ferrovial SE	9 796 211	1,88 %

(1) Voir Note 13. Parties liées.

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 EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	Revenu fixe	Obligation d'état d'Allemagne	11 421 256	0,85 %
	Action	SES SA	2 668 934	0,20 %
	Action	Safran	2 668 927	0,20 %
	Action	Scor SE	2 668 926	0,20 %
	Action	Infrastrutture Wireless Italianae SpA	2 668 924	0,20 %
	Action	Ferrari NV	2 668 896	0,20 %
	Action	Veolia Environnement SA	2 668 867	0,20 %
	Action	Stellantis NV	2 668 778	0,20 %
	Action	Airbus SE	2 668 752	0,20 %
	Action	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	2 613 747	0,19 %

10. Commission de Société de gestion et Commissions fixes**a) Commission de Société de gestion**

Conformément aux dispositions du Contrat de Société de gestion et sous réserve de ces dispositions, la Commission de 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 en particulier, tel qu'indiqué dans l'Annexe produit correspondante.

La Société de gestion peut payer une Commission de distribution au Distributeur sur la Commission de Société de gestion. Un Distributeur peut reverser une partie de la Commission de distribution à un distributeur délégué (selon le cas). La Société de gestion devra rémunérer les Gestionnaires d'investissement sur la Commission de Société de gestion comme convenu ponctuellement entre les deux parties. Chaque Gestionnaire d'investissement devra rémunérer, sur la Commission de gestion d'investissement applicable, tout Gestionnaire de portefeuille délégué désigné, comme convenu ponctuellement entre les 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, certaines commissions et dépenses, sauf indication contraire dans l'Annexe produit correspondante.

Les commissions et dépenses couvertes par l'accord susvisé comprennent les Frais d'administration, la Commission de dépositaire, les Commissions de l'Agent de registre et de transfert et 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 frais suivants :

- la Commission de gestion d'investissement ;
- la Commission de Société de gestion ;
- 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 ;

⁽¹⁾ Voir Note 13. Parties liées.

10. Commission de Société de gestion et Commissions fixes (suite)

b) Commissions fixes (suite)

- toute taxe ou tout 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) (toutes ces taxes ou tous ces impôts), sauf mention contraire dans l'Annexe produit correspondante ;
- les dépenses issues de toute activité publicitaire ou promotionnelle en lien avec la Société ;
- tout coût ou toute dépense supporté(e) en dehors du cours normal des activités de la Société, comme les frais exceptionnels (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.

Le pourcentage de la Commission de Société de gestion et les Commissions fixes de chaque Compartiment au 31 décembre 2023 est détaillé dans le tableau suivant :

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Commission de Société de gestion en % (par an)	Commissions fixes en % par an
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0290355717	jusqu'à 0,01	0,08
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0643975591	jusqu'à 0,01	0,08
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU2009147591	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866023	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1C	LU0290356871	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0614173549	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1C	LU0290356954	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	LU0614173895	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU2606231335	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2606231418	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	1C	LU0290357176	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1C	LU0290357259	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1D - GBP Hedged	LU2523865728	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU2523865991	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	1C	LU0290357507	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	1C	LU0290357846	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged	LU0290357929	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0962078753	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU0641007009	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0641007264	jusqu'à 0,15	0,10

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

10. Commission de Société de gestion et Commissions fixes (suite)

b) Commissions fixes (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Commission de Société de gestion en % (par an)	Commissions fixes en % par an
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged	LU0641007421	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	5C	LU0908508814	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	LU0290358224	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	LU0290358497	jusqu'à 0,02	0,08
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0335044896	jusqu'à 0,02	0,08
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	LU0321462870	jusqu'à 0,09	0,15
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged	LU0321462953	jusqu'à 0,25	0,15
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU2361257269	jusqu'à 0,30	0,10
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2C	LU1920015440	jusqu'à 0,10	0,15
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	LU0677077884	jusqu'à 0,10	0,15
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	LU0321463258	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0321463506	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	LU0321465469	jusqu'à 0,02	0,08
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0321464652	jusqu'à 0,02	0,08
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged	LU0378818131	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0690964092	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU0641006290	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3C - USD Hedged	LU0641006456	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged	LU0641006613	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	5C	LU0908508731	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0378818560	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1C	LU1920015796	jusqu'à 0,01	0,05
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	LU0429459356	jusqu'à 0,01	0,05
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2C - GBP Hedged	LU2610432036	jusqu'à 0,01	0,09
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged	LU1399300455	jusqu'à 0,01	0,09
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1C	LU1920015523	jusqu'à 0,01	0,05
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	LU0429458895	jusqu'à 0,01	0,05
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	LU0478205379	jusqu'à 0,02	0,10
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU0478205965	jusqu'à 0,02	0,10
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0643975161	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0468896575	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU2523866379	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866296	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0468897110	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1C	LU0484968903	jusqu'à 0,06	0,10
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	LU0484968812	jusqu'à 0,06	0,10
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0484969463	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1C	LU0524480265	jusqu'à 0,05	0,10

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

10. Commission de Société de gestion et Commissions fixes (suite)

b) Commissions fixes (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Commission de Société de gestion en % (par an)	Commissions fixes en % par an
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	LU0962071741	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0494592974	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	1C	LU0613540268	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0820950128	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	1C	LU0925589839	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D	LU2552296563	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0952581584	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	LU0942970103	jusqu'à 0,01	0,09
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU0942970285	jusqu'à 0,01	0,09
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0942970368	jusqu'à 0,01	0,09
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged	LU0942970442	jusqu'à 0,01	0,09
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	5C - EUR Hedged	LU0942970798	jusqu'à 0,01	0,09
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	LU1109943388	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU1109942653	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	LU1109939865	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU1094612022	jusqu'à 0,05	0,15
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	1C	LU2178481649	jusqu'à 0,06	0,10
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU2462217071	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2385068163	jusqu'à 0,10	0,10
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2385068247	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged	LU2385068320	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged	LU2385068593	jusqu'à 0,15	0,10
Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU2468423459	jusqu'à 0,05	0,10
Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	LU2504532131	jusqu'à 0,01	0,06
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	LU2504532487	jusqu'à 0,08	0,10
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	1D	LU2504537445	jusqu'à 0,02	0,10
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2158769930	jusqu'à 0,05	0,20
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	1C	LU2641054122	jusqu'à 0,01	0,06

10. Commission de Société de gestion et Commissions fixes (suite)

b) Commissions fixes (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Commission de Société de gestion en % (par an)	Commissions fixes en % par an
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF	1C	LU2641053827	jusqu'à 0,01	0,06
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	1C	LU2641054551	jusqu'à 0,01	0,06
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523218	jusqu'à 0,02	0,10
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523309	jusqu'à 0,02	0,10
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523481	jusqu'à 0,02	0,10
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523564	jusqu'à 0,02	0,10
Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF	1D	LU2662649503	jusqu'à 0,01	0,05
Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF	1D	LU2662649685	jusqu'à 0,01	0,05
Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF	1D	LU2662649412	jusqu'à 0,01	0,05

11. Frais de transaction

Les frais de transaction correspondent à l'ensemble des coûts et des frais encourus au titre de l'achat et de la vente de titres en portefeuille et d'instruments financiers, les frais et les commissions de courtage, les intérêts ou les impôts exigibles au titre de telles transactions d'achat et de vente, tel qu'éventuellement décrit plus en détail dans l'Annexe produit correspondante du Prospectus. Les frais de transaction sont inclus dans le coût des valeurs mobilières dans l'État de l'actif net et dans la plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les investissements et dans la plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les contrats à terme ferme (« futures ») dans l'État des opérations et variations de l'actif net.

Compartiment	Devise	Frais de transaction (dans la devise du Compartiment)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	52
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	70
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	USD	43
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	USD	35
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	834
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	22
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	EUR	9
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	EUR	726
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	JPY	9 984
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	USD	6 980
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	EUR	375
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	EUR	5
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	USD	42

12. Jetons de présence et intérêts des Administrateurs

À la suite de l'approbation des actionnaires lors de l'assemblée générale annuelle de la Société le 21 avril 2023 (l'« **AGA de 2023** »), la rémunération de M. Alfred François Brausch et de M. Thilo Wendenburg en tant qu'administrateurs indépendants a été approuvée pour la période allant de l'assemblée générale annuelle du 22 avril 2022 (l'« **AGA de 2022** ») jusqu'à la date de l'AGA de 2023. La rémunération de M. Alfred François Brausch, en sa qualité de président, était de 17 500 EUR, tandis que celle de M. Thilo Wendenburg était de 15 000 EUR pour cette période. La rémunération des administrateurs indépendants est versée par le biais de Commissions fixes et non au moyen des actifs des Compartiments.

12. Jetons de présence et intérêts des Administrateurs (suite)

La rémunération pour la période allant de l'AGA de 2023 à l'assemblée générale annuelle des actionnaires qui se tiendra le 19 avril 2024 (l'« **AGA de 2024** ») sera votée par les actionnaires lors de l'AGA de 2024. Veuillez vous reporter à la section Événements ultérieurs des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour de plus amples informations sur les montants proposés.

Afin d'éviter toute ambiguïté, les administrateurs non indépendants ne perçoivent pas de rémunération pour leur fonction d'administrateurs ni aucun autre avantage direct important qui leur est versé par la Société ou l'Agent de commissions fixes.

13. 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 administratifs et des services de distribution et de marketing aux différents Compartiments, sauf mention contraire dans l'Annexe produit correspondante. DWS Investment S.A. a le droit de percevoir des Commissions de Société de gestion, telles que précisées plus en détail 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, DWS Investments Hong Kong Limited et DWS Investment Management Americas, Inc agissent en qualité de Gestionnaire d'investissement et/ou de Gestionnaire de portefeuille délégué pour certains Compartiments, tel que précisé plus en détail à la Note 14. La Société de gestion devra rémunérer les Gestionnaires d'investissement sur la Commission de Société de gestion comme convenu ponctuellement entre les parties.

Chaque Gestionnaire d'investissement devra rémunérer, sur la Commission de gestion d'investissement applicable, tout Gestionnaire de portefeuille délégué désigné, tout fournisseur de services de meilleure exécution, comme convenu ponctuellement entre les parties.

DWS International GmbH fournit des services de meilleure exécution pour les Compartiments à réplication indirecte.

DWS Investments UK Limited a été désignée pour fournir certains services, comme convenu de temps à autre, y compris, mais sans s'y limiter, des conseils juridiques, réglementaires et fiscaux, la gestion des relations, la distribution, le marketing, l'assistance en matière de structuration et de restructuration et l'assistance relative aux enregistrements de la Société.

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, Deutsche Bank AG était la contrepartie de certaines conventions de swap conclues par la Société.

DWS Investment GmbH, désignée par la Société de gestion pour réaliser des Opérations de prêt de titres, a le droit de recevoir des commissions couvrant directement ou indirectement ses frais et commissions opérationnels et les frais résultant des Opérations de prêt de titres, tel qu'indiqué 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.

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

Les entités du Groupe Deutsche Bank AG et/ou du Groupe DWS peuvent participer à des activités de distribution liées aux Compartiments de la Société.

14. Gestionnaires d'investissement et Gestionnaires de portefeuille délégués désignés

Au 31 décembre 2023, DWS Investment GmbH agit en qualité de Gestionnaire d'investissement pour les Compartiments figurant ci-dessous :

- 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
- 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
- Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF
- Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF
- Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF

14. Gestionnaires d'investissement et Gestionnaires de portefeuille délégués désignés (suite)

- Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF
- Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF
- Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF
- Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF
- Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF
- Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF
- Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF
- Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF
- Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF
- Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF
- Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF
- Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF
- Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF
- Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF
- Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF
- Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF
- Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF
- Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF

Au 31 décembre 2023, 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 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 EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF

Au 31 décembre 2023, 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 réplique indirecte.

14. Gestionnaires d'investissement et Gestionnaires de portefeuille délégués désignés (suite)

Sauf mention contraire dans l'Annexe produit correspondante, DWS Investments UK Limited, DWS Investments Hong Kong Limited et DWS Investment Management Americas, Inc peuvent agir en tant que Gestionnaire de portefeuille délégué pour les Compartiments à réplification directe pour lesquels DWS Investment GmbH agit en qualité de Gestionnaire d'investissement.

15. Dividendes distribués

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, la Société a décidé de verser un acompte sur dividendes aux Actionnaires des Actions de distribution des Compartiments mentionnés ci-dessous de la façon suivante :

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Date ex-dividende	Devise de la Catégorie d'actions	Dividende par action
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0643975591	8 février 2023	EUR	1,6230
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0643975591	23 août 2023	EUR	1,6097
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866023	8 février 2023	GBP	0,0246
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866023	23 août 2023	GBP	0,0535
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0614173549	8 février 2023	EUR	0,1175
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0614173549	23 août 2023	EUR	0,3147
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	LU0614173895	8 février 2023	EUR	0,2991
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	LU0614173895	23 août 2023	EUR	0,5689
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1D - GBP Hedged	LU2523865728	23 août 2023	GBP	0,0259
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0962078753	8 février 2023	EUR	0,3063
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0962078753	24 mai 2023	EUR	0,3202
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0962078753	23 août 2023	EUR	0,3415
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0962078753	15 novembre 2023	EUR	0,3544
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0641007264	8 février 2023	GBP	0,0396
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0641007264	24 mai 2023	GBP	0,0395
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0641007264	23 août 2023	GBP	0,0402
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0641007264	15 novembre 2023	GBP	0,0453
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged	LU0641007421	8 février 2023	CHF	0,1744
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged	LU0641007421	24 mai 2023	CHF	0,1599
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged	LU0641007421	23 août 2023	CHF	0,1643
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged	LU0641007421	15 novembre 2023	CHF	0,1708
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0335044896	8 février 2023	EUR	0,7986
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0335044896	23 août 2023	EUR	1,6983
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0335044896	15 novembre 2023	EUR	1,1219
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU2361257269	8 février 2023	EUR	0,0874
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU2361257269	24 mai 2023	EUR	0,1557

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

15. Dividendes distribués (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Date ex-dividende	Devise de la Catégorie d'actions	Dividende par action
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU2361257269	23 août 2023	EUR	0,1226
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU2361257269	15 novembre 2023	EUR	0,1518
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	LU0677077884	8 février 2023	USD	0,1512
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	LU0677077884	24 mai 2023	USD	0,1472
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	LU0677077884	23 août 2023	USD	0,1512
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	LU0677077884	15 novembre 2023	USD	0,1471
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0321464652	8 février 2023	GBP	3,8734
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0321464652	23 août 2023	GBP	3,5677
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0690964092	8 février 2023	EUR	0,7479
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0690964092	24 mai 2023	EUR	0,8019
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0690964092	23 août 2023	EUR	0,8400
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0690964092	15 novembre 2023	EUR	0,8696
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU0641006290	8 février 2023	GBP	0,1021
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU0641006290	24 mai 2023	GBP	0,1053
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU0641006290	23 août 2023	GBP	0,1059
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU0641006290	15 novembre 2023	GBP	0,1179
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	LU0429459356	8 février 2023	USD	1,0756
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	LU0429459356	24 mai 2023	USD	1,1394
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	LU0429459356	23 août 2023	USD	1,2167
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	LU0429459356	15 novembre 2023	USD	1,2656
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged	LU1399300455	8 février 2023	EUR	0,3591
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged	LU1399300455	24 mai 2023	EUR	0,5488
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged	LU1399300455	23 août 2023	EUR	0,5916
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged	LU1399300455	15 novembre 2023	EUR	0,6762
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	LU0429458895	8 février 2023	USD	1,3351
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	LU0429458895	23 août 2023	USD	1,6011
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU0478205965	8 février 2023	EUR	0,0309
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU0478205965	24 mai 2023	EUR	0,0345
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU0478205965	23 août 2023	EUR	0,0366
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU0478205965	15 novembre 2023	EUR	0,0392
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0468896575	8 février 2023	EUR	0,9944
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0468896575	23 août 2023	EUR	0,9757
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866296	8 février 2023	GBP	0,0146
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866296	23 août 2023	GBP	0,0306
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0468897110	8 février 2023	EUR	0,4493
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0468897110	23 août 2023	EUR	0,3970

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

15. Dividendes distribués (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Date ex-dividende	Devise de la Catégorie d'actions	Dividende par action
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	LU0484968812	8 février 2023	EUR	0,5154
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	LU0484968812	24 mai 2023	EUR	0,5491
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	LU0484968812	23 août 2023	EUR	0,6116
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	LU0484968812	15 novembre 2023	EUR	0,6571
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	LU0962071741	8 février 2023	EUR	1,6717
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	LU0962071741	23 août 2023	EUR	1,6674
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D	LU2552296563	23 août 2023	EUR	0,0581
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D	LU2552296563	15 novembre 2023	EUR	0,0361
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	LU0942970103	8 février 2023	USD	0,2057
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	LU0942970103	24 mai 2023	USD	0,2091
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	LU0942970103	23 août 2023	USD	0,2276
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	LU0942970103	15 novembre 2023	USD	0,2275
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0942970368	8 février 2023	GBP	0,2425
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0942970368	24 mai 2023	GBP	0,3465
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0942970368	23 août 2023	GBP	0,3690
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0942970368	15 novembre 2023	GBP	0,4351
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU1109942653	8 février 2023	EUR	0,1488
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU1109942653	24 mai 2023	EUR	0,1520
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU1109942653	23 août 2023	EUR	0,1601
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU1109942653	15 novembre 2023	EUR	0,1705
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	LU1109939865	8 février 2023	EUR	0,2998
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	LU1109939865	23 août 2023	EUR	0,2985
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU1094612022	8 février 2023	USD	0,3242
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU1094612022	23 août 2023	USD	0,2899
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2385068163	8 février 2023	EUR	0,0251
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2385068163	24 mai 2023	EUR	0,0251
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2385068163	23 août 2023	EUR	0,0261
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2385068163	15 novembre 2023	EUR	0,0267
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2385068247	8 février 2023	GBP	0,0249

15. Dividendes distribués (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Date ex-dividende	Devise de la Catégorie d'actions	Dividende par action
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2385068247	24 mai 2023	GBP	0,0490
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2385068247	15 novembre 2023	GBP	0,0279
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged	LU2385068320	8 février 2023	USD	0,0324
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged	LU2385068320	24 mai 2023	USD	0,0257
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged	LU2385068320	23 août 2023	USD	0,0265
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged	LU2385068320	15 novembre 2023	USD	0,0241
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged	LU2385068593	8 février 2023	EUR	0,0236
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged	LU2385068593	24 mai 2023	EUR	0,0245
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged	LU2385068593	23 août 2023	EUR	0,0257
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged	LU2385068593	15 novembre 2023	EUR	0,0261
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	LU2504532487	8 février 2023	EUR	0,0877
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	LU2504532487	24 mai 2023	EUR	0,1085
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	LU2504532487	23 août 2023	EUR	0,1238
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	LU2504532487	15 novembre 2023	EUR	0,1353
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	1D	LU2504537445	8 février 2023	EUR	0,1437
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	1D	LU2504537445	23 août 2023	EUR	0,3420

16. Commission d'audit et autres frais

La rémunération de tous les travaux effectués par le cabinet d'audit agréé, pour l'exercice, est incluse dans la Commission fixe. Les honoraires versés à KPMG Audit S.à r.l. en 2023 se sont élevés à 133 300 EUR (hors TVA) pour les travaux d'audit statutaire. Les autres frais de service d'audit payés à KPMG Audit S.à r.l. en 2023 se sont élevés à 51 900 EUR (hors TVA). Les autres frais de service hors audit payés à KPMG Audit S.à r.l. en 2023 s'élevaient à 0 EUR. Aucun autre honoraire de conseil en fiscalité n'a été payé à KPMG Audit S.à r.l par la Société.

17. Commissions en nature

Aucun accord portant sur des commissions en nature n'a été conclu avec des courtiers par la Société de gestion ou le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire de portefeuille délégué concerné(s) au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

18. Publication d'informations SFDR

Les informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales des compartiments publiant des informations conformément à l'article 8, paragraphe 1 du SFDR comme l'exige l'article 50, paragraphe 2, des normes techniques réglementaires (RTS) du SFDR et les informations sur les investissements durables pour le compartiment publiant des informations conformément à l'article 9, paragraphes 1, 2 et 3 du SFDR comme l'exige l'article 58 des RTS du SFDR sont publiés dans l'annexe non audité « Publication périodique pour les produits visés aux articles 8 et 9 dans le cadre du SFDR et du Règlement européen sur la taxinomie – non audité ».

19. Événements ultérieurs

1. Le 1^{er} février 2024, DWS Investments UK Limited et Deutsche Bank AG, succursale de Londres, ont changé de siège social qui se situe désormais au 21 Moorfields, Londres EC2Y 9DB, Royaume-Uni.

Xtrackers II

Notes aux États financiers (suite)

19. Événements ultérieurs (suite)

2. Le 2 février 2024, la Société a informé les Actionnaires de sa décision de verser un acompte sur dividendes aux Actionnaires des Actions de distribution des Compartiments mentionnés ci-dessous comme suit :

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Date ex-dividende	Devise de la Catégorie d'actions	Dividende par action
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0335044896	21 février 2024	EUR	1,2010
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0321464652	21 février 2024	GBP	4,5876
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	LU0429459356	21 février 2024	USD	2,6230
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	LU0429458895	21 février 2024	USD	1,8438
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0468896575	21 février 2024	EUR	1,1134
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0468897110	21 février 2024	EUR	0,4830
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	LU0484968812	21 février 2024	EUR	1,3727
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0614173549	21 février 2024	EUR	0,6697
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	LU0614173895	21 février 2024	EUR	0,8226
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU0641006290	21 février 2024	GBP	0,2417
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0641007264	21 février 2024	GBP	0,0907
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0643975591	21 février 2024	EUR	1,7257
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0690964092	21 février 2024	EUR	1,7890
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU0478205965	21 février 2024	EUR	0,0810
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged	LU0641007421	21 février 2024	CHF	0,3094
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	LU0962071741	21 février 2024	EUR	1,7960
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0962078753	21 février 2024	EUR	0,7191
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	LU0942970103	21 février 2024	USD	0,4765
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0942970368	21 février 2024	GBP	0,8063
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	LU1109939865	21 février 2024	EUR	0,3024
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU1109942653	21 février 2024	EUR	0,3422
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU1094612022	21 février 2024	USD	0,2741
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged	LU1399300455	21 février 2024	EUR	1,2276
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	LU0677077884	21 février 2024	USD	0,3018
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2158769930	21 février 2024	USD	1,0777
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU2361257269	21 février 2024	EUR	0,2706
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2385068163	21 février 2024	EUR	0,0555
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2385068247	21 février 2024	GBP	0,0572
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged	LU2385068320	21 février 2024	USD	0,0589
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT UCITS ETF	4D - EUR Hedged	LU2385068593	21 février 2024	EUR	0,0543
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1D - GBP Hedged	LU2523865728	21 février 2024	GBP	0,0452

19. Événements ultérieurs (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Date ex-dividende	Devise de la Catégorie d'actions	Dividende par action
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866023	21 février 2024	GBP	0,0607
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866296	21 février 2024	GBP	0,0370
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	1D	LU2504537445	21 février 2024	EUR	0,3706
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	LU2504532487	21 février 2024	EUR	0,2752
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D	LU2552296563	21 février 2024	EUR	0,0749
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2606231418	21 février 2024	GBP	0,0457
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523564	21 février 2024	EUR	0,1200
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523481	21 février 2024	EUR	0,1300
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523309	21 février 2024	EUR	0,1500
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523218	21 février 2024	EUR	0,1700

3. L'assemblée générale annuelle des Actionnaires qui se tiendra le 19 avril 2024 (l'« **AGA de 2024** ») approuvera la rémunération des Administrateurs indépendants Alfred François Brausch et Thilo Wendenburg, et de Stefan Kreuzkamp en tant qu'Administrateur externe. Le montant proposé pour Alfred François Brausch, qui a agi en qualité de président depuis l'assemblée générale annuelle qui s'est tenue en 2023 (l'« **AGA de 2023** »), est de 25 000 euros par an, qui seront payés au titre de ses fonctions au prorata de la période allant de l'AGA de 2023 jusqu'à la date de l'AGA de 2024. Le montant proposé pour Thilo Wendenburg est de 20 000 euros par an, qui seront payés au titre de ses fonctions au prorata de la période allant de l'AGA de 2023 jusqu'à la date de l'AGA de 2024. Le montant proposé pour Stefan Kreuzkamp est de 10 000 euros par an, qui seront payés au titre de ses fonctions au prorata de la période allant de l'AGA de 2023 jusqu'à la date de l'AGA de 2024. Le montant proposé est basé sur le nombre de Compartiments à la fin de l'exercice clos le 31 décembre 2023. Afin d'éviter toute ambiguïté, les Administrateurs non indépendants ne perçoivent pas de rémunération de la Société.

Informations destinées aux Actionnaires - non auditées

1. Publication en ligne des portefeuilles d'investissements, 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 réplication de l'indice

En vertu du Prospectus, chaque Contrepartie de swap peut effectuer des opérations de couverture liées à la (aux) Opération(s) de swap négociée(s) de gré à gré. Selon la (les) Opération(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 ajustées afin de refléter certains coûts de réplication 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 frais, 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. Dans des conditions de marché extrêmes et des circonstances exceptionnelles, notamment en ce qui concerne les marchés moins développés et les marchés émergents, ces coûts peuvent augmenter de manière significative et, par conséquent, les Coûts des opérations de swap négociées de gré à gré peuvent augmenter. Les Actionnaires assumeront donc indirectement les Coûts des opérations de swap négociées de gré à gré qui peuvent être répercutés sur certains Compartiments à réplication indirecte par la Contrepartie de swap et peuvent affecter la capacité du Compartiment à réplication indirecte à atteindre son Objectif d'investissement. Les Coûts des opérations de swap négociées de gré à gré peuvent également être différents en fonction de l'Indice de référence dont le Compartiment vise à répliquer la performance. Les Coûts des opérations de swap négociées de gré à gré peuvent également varier de temps en temps en fonction des conditions réelles du marché.

- 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 réplication 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 refléter la performance de l'Indice de référence ; 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 de l'Indice 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 réplication de l'indice seront associés (i) à l'achat, la vente et l'emprunt et/ou au financement des composants de l'Indice de référence afin de refléter la performance de l'Indice de référence ; (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 ; (iii) aux frais financiers encourus pour se protéger des mouvements du marché très importants des composants de l'Indice de référence ; (iv) aux frais financiers inattendus liés aux mouvements de marché très importants ; (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 avec effet de levier de la version longue de l'Indice de référence). Dans ce cas, les coûts de réplication de l'indice seront associés (i) à l'emprunt et/ou au financement des composants de l'Indice de référence afin de refléter 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 la (des) Opération(s) de swap négociée(s) de gré à gré en plus de tout paiement contractuel exigible en vertu de la (des) Opération(s) de swap négociée(s) de gré à gré. Les Opérations de swap négociées de gré à gré des Compartiments suivants ont été ajustées des chiffres ci-dessous dans l'évaluation des swaps en vigueur au 31 décembre 2023. Une valeur positive dans le tableau signifie que les Opérations de swap négociées de gré à gré du Compartiment concerné ont fait l'objet d'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 la (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.

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Ajustement
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	ID	LU1109939865	69 pb

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - non auditées (suite)

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 CSSF 11/512.

4. Autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice

1. Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, les Compartiments suivants ont été lancés :

Compartiment	Catégorie d'actions/Code ISIN	Date de lancement
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D / LU2158769930	12 avril 2023
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	1C / LU2641054122	12 septembre 2023
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	1C / LU2641054551	12 septembre 2023
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF	1C / LU2641053827	12 septembre 2023
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D / LU2673523218	8 novembre 2023
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D / LU2673523309	8 novembre 2023
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D / LU2673523481	8 novembre 2023
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D / LU2673523564	8 novembre 2023
Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF	1D / LU2662649503	6 décembre 2023
Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF	1D / LU2662649685	6 décembre 2023
Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF	1D / LU2662649412	6 décembre 2023

2. Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, les catégories d'actions suivantes ont été lancées :

Compartiment	Catégorie d'actions/Code ISIN	Date de lancement
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D / LU2552296563	24 janvier 2023
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2C – USD Hedged / LU2606231335	12 mai 2023
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2D – GBP Hedged / LU2606231418	12 mai 2023
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2C – GBP Hedged / LU2610432036	12 mai 2023

3. À la suite de la liquidation de Xtrackers II iTraxx Crossover Swap UCITS ETF (le « **Compartiment** ») le 26 avril 2023 (la « **Date de liquidation** »), le Produit de rachat a été versé aux Actionnaires du Compartiment. Le Produit de rachat a été calculé en fonction de la Valeur liquidative (la « **VL** ») par action à la Date de liquidation (la « **VL finale** »).

Le 12 juillet 2023, le Conseil d'administration de la Société a informé les anciens Actionnaires du Compartiment que le Compartiment a reçu un remboursement lié à une pénalité appliquée conformément au Règlement sur les Dépositaires centraux de titres (le « **Montant résiduel** »). Le Montant résiduel n'a pas été pris en compte dans la VL finale.

Par conséquent, le Montant résiduel a été versé aux anciens Actionnaires du Compartiment le 14 juillet 2023 ou aux alentours de cette date par le biais d'un paiement au mandataire du Dépositaire commun pour les paiements ultérieurs aux DCTI. Les détails du Montant résiduel sont présentés dans le tableau ci-dessous :

Compartiment	Montant résiduel total	Montant résiduel par action
Xtrackers II iTraxx Crossover Swap UCITS ETF	3 495,12 EUR	0,016575076 EUR

Informations destinées aux Actionnaires - non auditées (suite)

4. Autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice (suite)

4. Le 9 août 2023, la Société a informé les Actionnaires qu'à la suite des exigences du Securities and Exchange Board of India pour les Investisseurs de portefeuille étrangers (« **FPI** ») portant sur la divulgation des informations de leur(s) bénéficiaire(s) effectifs (« **BO** ») et de leur(s) Responsable(s) de gestion (« **SMO** ») en ce qui concerne les règles de prévention du blanchiment d'argent qui, entre autres, ont abaissé le seuil d'identification des BO de 25 % à 10 % pour les structures d'entreprise, il est impératif que tout bénéficiaire effectif final dans l'un des Compartiments de la Société informe la Société dès que possible, de manière continue, s'il détient 10 % ou plus des Actions en circulation de (i) la Société dans son ensemble ou (ii) l'un des Compartiments de la Société afin que les divulgations d'informations nécessaires puissent être faites par la Société et que les comptes relatifs à la garde des titres indiens soient maintenus.

Les Actionnaires ont été priés d'informer la Société de l'existence d'un bénéficiaire effectif final (BO) détenant 10 % ou plus des Actions de la Société dans son ensemble ou dans l'un des Compartiments de la Société, en nous fournissant les informations suivantes par e-mail à l'adresse Xtrackers@dws.com.

- (a) Le nom du BO ;
- (b) Le nombre d'Actions détenues à la date à laquelle les Actionnaires fournissent les informations ;
- (c) Le pourcentage d'Actions détenues à cette date ;
- (d) Les détails de toute entité ou personne physique ayant le contrôle sur le BO en vertu, par exemple, de la détention d'une participation de 10 % ou plus dans le BO ou du contrôle des décisions de gestion ou de politique du BO, y compris en vertu de leurs droits de participation ou de gestion, des accords d'actionnaires ou des accords de vote ; et
- (e) Toute entité ou personne ayant le contrôle de cette entité au titre du point 4. et en vertu de dispositions similaires, jusqu'à ce que l'Actionnaire atteigne l'entité ou la personne finale de cette chaîne.

Les Actionnaires ont également été invités à informer la Société dès que possible et de manière continue si l'une des informations fournies ci-dessus venait à changer de manière significative, ou si une entité ou une personne entrait dans le champ d'application de ces exigences.

5. Le 27 octobre 2023, le Conseil d'administration de la Société a informé les actionnaires des Compartiments suivants d'un changement d'Indice de référence et d'Administrateur de l'Indice de chaque Compartiment à compter du 30 novembre 2023, comme indiqué dans le tableau ci-dessous :

Compartiment	Ancien Administrateur de l'Indice	Nouvel Administrateur de l'Indice	Ancien Indice de référence	Nouvel Indice de référence
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Deutsche Bank AG	Solactive AG	DEUTSCHE BANK EURO OVERNIGHT RATE INDEX®	SOLACTIVE €STR +8.5 DAILY TOTAL RETURN INDEX
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Deutsche Bank AG	Solactive AG	FED FUNDS EFFECTIVE RATE TOTAL RETURN INDEX®	SOLACTIVE FEDL DAILY TOTAL RETURN INDEX
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Deutsche Bank AG	Solactive AG	SONIA TOTAL RETURN INDEX®	SOLACTIVE SONIA DAILY TOTAL RETURN INDEX

Afin d'éviter toute ambiguïté, les règles de chaque Nouvel Indice de référence sont sensiblement les mêmes que celles de l'Indice de référence actuel concerné.

6. Le conflit entre la Russie et l'Ukraine a marqué un tournant spectaculaire en Europe, ce qui, entre autres choses, a affecté l'architecture de sécurité et les politiques énergétiques à long terme de l'Europe et entraîné une volatilité considérable. Cette volatilité devrait se poursuivre. Cependant, les effets spécifiques ou possibles de la crise (à moyen ou long termes) sur l'économie, les marchés et les secteurs individuels, ainsi que les implications sociales, ne peuvent pas être évalués de manière concluante en raison des incertitudes au moment de la préparation du présent rapport. La Société de gestion poursuit donc ses efforts, dans le cadre de sa stratégie de gestion de risque, pour évaluer ces incertitudes et leur impact possible sur les activités, la liquidité et la performance du compartiment respectif. 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.

5. Informations relatives aux rémunérations en application de la Directive OPCVM V

La Société de gestion est une filiale de DWS Group GmbH & Co. KGaA (« DWS KGaA ») et est soumise aux exigences réglementaires de la Cinquième directive sur les Organismes de placement collectif en valeurs mobilières (la « Directive sur les OPCVM »), ainsi qu'aux directives de l'Autorité européenne des marchés financiers sur les Politiques de rémunération saines (« Lignes directrices de l'AEMF ») concernant la conception de son système de rémunération.

Politique de rémunération et gouvernance

La Société de gestion est régie par la Politique de rémunération à l'échelle du Groupe que DWS KGaA a adopté pour elle-même et pour l'ensemble de ses filiales (« Groupe DWS » ou uniquement « Groupe »).

Conformément à la structure du Groupe, des comités ont été mis en place pour s'assurer que le système de rémunération est adapté et conforme aux exigences réglementaires en matière de rémunération. Ils ont aussi la responsabilité de sa vérification.

À ce titre, le Comité de Rémunération de DWS a été chargé par le Conseil d'administration de DWS KGaA d'élaborer et de concevoir des principes de rémunération durable, de formuler des recommandations sur la rémunération globale et d'assurer une gouvernance et une supervision appropriées en matière de rémunération et d'avantages pour le Groupe.

En outre, le Comité de Rémunération a été créé pour aider le Conseil de surveillance de DWS KGaA dans le suivi de la structure appropriée des systèmes de rémunération pour tous les employés du Groupe. Cela s'effectue en tenant compte des effets du système de rémunération sur la gestion des risques, du capital et de la liquidité à l'échelle du groupe, ainsi que de la cohérence de la stratégie de rémunération avec l'entreprise et la stratégie de risque du Groupe.

Le contrôle annuel interne au niveau du Groupe DWS a conclu à l'adéquation du système de rémunération et il n'a pas été constaté d'irrégularités importantes.

Structure de rémunération

La rémunération des employés se compose d'une Rémunération fixe et d'une Rémunération variable.

La Rémunération fixe rémunère les salariés pour leurs compétences, leur expérience et leurs aptitudes, en accord avec les exigences, le périmètre et la portée de leur rôle.

La Rémunération variable prend en considération les performances au niveau du groupe, de la division et de l'individu. La Rémunération variable se compose généralement de deux éléments, la « Composante de la franchise » et la « Composante individuelle ».

La Composante de la franchise est déterminée sur la base de la performance de trois indicateurs clés de performance (KPI) au niveau du Groupe DWS. Pour l'année de performance 2023, ces valeurs étaient les suivantes : le ratio coût-revenu ajusté (« CIR »), les flux nets et les mesures ESG.

La Composante individuelle de la Rémunération variable tient compte de différents facteurs financiers et non financiers, des comparaisons au sein du groupe de pairs et des considérations relatives à la rétention. La Rémunération variable peut être réduite en conséquence ou entièrement annulée en cas de contributions négatives à la performance ou de mauvaise conduite. En principe, elle n'est accordée et payée que si son octroi est abordable pour le Groupe. La Rémunération variable garantie n'est normalement pas accordée aux employés. De manière exceptionnelle, une Rémunération variable garantie peut être accordée aux nouvelles recrues, mais uniquement lors de leur première année d'emploi.

La stratégie de rémunération est conçue pour parvenir à un équilibre approprié entre la Rémunération fixe et la Rémunération variable. Ainsi, il est possible d'aligner la rémunération des employés sur les intérêts des clients, des investisseurs et des actionnaires, ainsi que sur les normes du secteur. Cela garantit également que la Rémunération fixe représente une proportion suffisamment élevée de la rémunération totale afin de permettre au Groupe de bénéficier d'une flexibilité totale dans l'octroi de la Rémunération variable.

Calcul de la Rémunération variable et mesures d'ajustement appropriées en fonction du risque

Le montant total de la Rémunération variable fait l'objet de mesures appropriées d'ajustement au risque, y compris des ajustements au préalable et a posteriori. La solide méthodologie est conçue pour assurer que le calcul de la Rémunération variable intègre la performance ajustée du risque du Groupe ainsi que sa position en capital et en liquidité.

Plusieurs considérations sont utilisées pour évaluer les performances des unités opérationnelles. Ces performances sont évaluées dans le contexte des objectifs financiers et non financiers en s'appuyant sur des fiches d'évaluation équilibrées. L'attribution d'une Rémunération variable aux zones d'infrastructure et en particulier aux fonctions de contrôle dépend des résultats globaux du Groupe, mais ne découle pas des résultats des secteurs d'activité qu'ils supervisent.

Informations destinées aux Actionnaires - non auditées (suite)

5. Informations relatives aux rémunérations en application de la Directive OPCVM V (suite)

Les principes de détermination de la Rémunération variable s'appliquent au niveau de chaque employé, qui définissent de manière détaillée les facteurs et mesures à prendre en considération lors de la prise de décisions relatives à la Rémunération variable individuelle. Ils incluent, par exemple, la performance d'investissement, la rétention des clients, des considérations culturelles et une évaluation des objectifs et des résultats sur la base de l'approche de la « Performance totale ». Par ailleurs, toute indication d'une fonction de contrôle, toute sanction disciplinaire et leur impact sur la Rémunération variable doivent également être pris en considération.

Rémunération durable

La durabilité et les risques en la matière sont un élément essentiel qui détermine la Rémunération variable. Par conséquent, la politique de rémunération est entièrement conforme et cohérente avec les risques liés à la durabilité. Par conséquent, le Groupe DWS encourage les comportements qui profitent aux clients tout en favorisant la performance à long terme de l'entreprise. Les facteurs de durabilité pertinents sont régulièrement examinés et intégrés dans la conception du système de rémunération.

Rémunération pour 2023

Le Comité de Rémunération de DWS a contrôlé la capacité financière de la Rémunération variable pour 2023 et conclu que les niveaux de capital et de liquidité du Groupe restent supérieurs aux exigences réglementaires minimales et au seuil interne d'appétence au risque.

Dans le cadre de la Rémunération variable globale pour 2023, accordée en mars 2024, la Composante de la franchise est attribuée aux employés éligibles conformément à l'évaluation des KPI définis. Le Conseil d'administration a reconnu la contribution considérable des salariés et a fixé un taux de réalisation cible de 82,5 % pour 2023.

Identification des preneurs de risques importants

Conformément à la Loi du 17 décembre 2010 concernant les Organismes de placement collectif (telle qu'amendée par la suite) en conjonction avec les Lignes directrices de l'AEMF, la Société a identifié les Preneurs de risques importants. Le processus d'identification a été fondé sur les Politiques du groupe et repose sur une évaluation de l'impact des catégories suivantes concernant le personnel sur le profil de risque de la Société ou d'un fonds qu'elle gère : (a) Membres du Conseil/de la Haute direction, (b) Gestionnaires de portefeuille/d'investissement, (c) Fonctions de contrôle, (d) Direction du personnel, du marketing et des ressources humaines, (e) autres personnes (« Preneurs de risques ») occupant un poste d'influence important, (f) autres employés recevant une tranche de rémunération équivalente à celle d'autres Preneurs de risques, dont les fonctions ont un impact sur le profil de risque de la Société ou du Groupe. Le versement d'au moins 40 % de la Rémunération variable des Preneurs de risques importants est différé. De plus, au moins 50 % de la part versée immédiatement et de la part différée, sont octroyés sous la forme d'instruments fondés sur des fonds ou sur des actions du Groupe pour les Principaux professionnels de l'investissement. Toutes les composantes différées sont soumises à plusieurs conditions de résultat et des dispositions de révocation qui garantissent une prise en compte appropriée des risques a posteriori. Dans le cas où la Rémunération variable est inférieure à 50 000 EUR, les Preneurs de risques importants en perçoivent immédiatement l'intégralité en numéraire.

Informations sur l'ensemble des rémunérations versées par la Société de gestion en 2023⁽¹⁾.

Nombre d'employés en moyenne annuelle	99
Rémunération totale ⁽²⁾	15 739 813 EUR
Salaire fixe	12 528 700 EUR
Rémunération variable	3 211 113 EUR
Le cas échéant : Intérêt reporté	0 EUR
Rémunération totale pour la Haute Direction ⁽³⁾	1 476 953 EUR
Rémunération totale pour les autres Preneurs de risques importants ⁽⁴⁾	0 EUR
Rémunération totale pour les employés à des Fonctions de contrôle	2 077 858 EUR

⁽¹⁾ Dans le cas où des activités de gestion de portefeuille ou de risque ont été déléguées par la Société de gestion, les données sur les rémunérations des délégués ne figurent pas dans le tableau.

⁽²⁾ Compte tenu de divers éléments de rémunération tels que définis par les Lignes directrices de l'AEMF, qui peuvent inclure des paiements ou des avantages monétaires (tels que des liquidités, des actions, des options, des cotisations de retraite) ou des avantages non (directement) monétaires (tels que des prestations annexes ou des allocations spéciales pour véhicule de fonction, téléphone portable, etc.).

⁽³⁾ La Haute direction désigne uniquement les membres du Conseil d'administration de la Société de gestion. Les Membres du Conseil d'administration correspondent à la définition de dirigeants. Excepté les Membres de la Haute Direction, aucun autre dirigeant n'a été identifié.

⁽⁴⁾ Les Preneurs de risques avec des fonctions de contrôle identifiés sont présentés dans la ligne « Employés à des fonctions de contrôle ».

6. Changements 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.

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - **non auditées (suite)**

7. Total Expense Ratio

Le tableau suivant présente le Total Expense Ratio (TER) au niveau des Catégories d'actions des Compartiments pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 :

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	TER (par an)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0290355717	0,09 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0643975591	0,09 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU2009147591	0,20 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866023	0,20 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1C	LU0290356871	0,15 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0614173549	0,15 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1C	LU0290356954	0,15 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	LU0614173895	0,15 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU2606231335	0,20 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2606231418	0,20 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	1C	LU0290357176	0,15 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1C	LU0290357259	0,15 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1D - GBP Hedged	LU2523865728	0,20 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU2523865991	0,20 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	1C	LU0290357507	0,15 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	1C	LU0290357846	0,15 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged	LU0290357929	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0962078753	0,20 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU0641007009	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0641007264	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged	LU0641007421	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	5C	LU0908508814	0,20 %
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	LU0290358224	0,15 %
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	LU0290358497	0,10 %
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0335044896	0,10 %
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	LU0321462870	0,24 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged	LU0321462953	0,40 %

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - non auditées (suite)

7. Total Expense Ratio (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	TER (par an)
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU2361257269	0,40 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2C	LU1920015440	0,25 %
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	LU0677077884	0,25 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	LU0321463258	0,15 %
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0321463506	0,15 %
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	LU0321465469	0,10 %
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0321464652	0,10 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged	LU0378818131	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged	LU0690964092	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU0641006290	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3C - USD Hedged	LU0641006456	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged	LU0641006613	0,25 %
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	5C	LU0908508731	0,20 %
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0378818560	0,20 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1C	LU1920015796	0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	LU0429459356	0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2C - GBP Hedged	LU2610432036	0,10 %
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged	LU1399300455	0,10 %
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1C	LU1920015523	0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	LU0429458895	0,06 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	LU0478205379	0,12 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU0478205965	0,12 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0643975161	0,15 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0468896575	0,15 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU2523866379	0,20 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2523866296	0,20 %
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0468897110	0,15 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1C	LU0484968903	0,16 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	LU0484968812	0,16 %
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0484969463	0,15 %

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - non auditées (suite)

7. Total Expense Ratio (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	TER (par an)
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1C	LU0524480265	0,15 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	LU0962071741	0,15 %
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0494592974	0,25 %
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	1C	LU0613540268	0,15 %
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0820950128	0,20 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	1C	LU0925589839	0,15 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D	LU2552296563	0,15 %
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0952581584	0,15 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	LU0942970103	0,10 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged	LU0942970285	0,10 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged	LU0942970368	0,10 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged	LU0942970442	0,10 %
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	5C - EUR Hedged	LU0942970798	0,10 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	LU1109943388	0,20 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU1109942653	0,20 %
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	LU1109939865	0,25 %
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU1094612022	0,20 %
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	1C	LU2178481649	0,16 %
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU2462217071	0,20 %
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2385068163	0,20 %
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged	LU2385068247	0,25 %
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged	LU2385068320	0,25 %
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged	LU2385068593	0,25 %
Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU2468423459	0,15 %
Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	LU2504532131	0,07 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	1D	LU2504532487	0,18 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	1D	LU2504537445	0,12 %
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU2158769930	0,25 %
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	1C	LU2641054122	0,07 %
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF	1C	LU2641053827	0,07 %

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - **non auditées (suite)**

7. Total Expense Ratio (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	TER (par an)
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF	1C	LU2641054551	0,07 %
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523218	0,12 %
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523309	0,12 %
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523481	0,12 %
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU2673523564	0,12 %
Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF	1D	LU2662649503	0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF	1D	LU2662649685	0,06 %
Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF	1D	LU2662649412	0,06 %

Le pourcentage du TER est présenté dans la devise de la Catégorie d'actions.

7. Total Expense Ratio (suite)

Le TER exprime à titre rétrospectif la somme de tous les frais et coûts accessoires prélevés de manière continue sur les actifs de l'organisme de placement collectif (charges d'exploitation) en pourcentage de l'actif net. Il est en principe calculé comme suit, conformément à la Directive de l'Asset Management Association Switzerland (AMAS) pour le calcul et la publication du TER d'organismes de placement collectif à compter du 16 mai 2008 (en date du 5 août 2021) :

$$\% \text{ du TER} = \frac{\text{Total des charges d'exploitation en UM}^*}{\text{Actif net moyen en UM}^*} \times 100$$

*UM = unités monétaires dans lesquelles l'organisme de placement collectif est libellé

Où

- les charges d'exploitation sont égales aux charges totales, à l'exclusion des revenus de placement négatifs et
- l'actif net moyen du fonds correspond à la moyenne arithmétique du total de l'actif net du fonds pour chaque Jour d'évaluation.

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - **non auditées (suite)**

8. Performance

Le tableau suivant présente la performance de toutes les Catégories d'actions au cours des trois dernières années.

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0290355717	(3,59)	(18,55)	7,06	(3,44)	(18,44)	7,15	(0,15)	(0,11)	(0,09)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0643975591	(3,53)	(18,50)	7,12	(3,44)	(18,44)	7,15	(0,09)	(0,06)	(0,03)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾	LU2009147591	(2,91)	(16,82)	9,29	(3,44)	(18,44)	7,15	0,53	1,62	2,14
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾⁽²⁾	LU2523866023	-	(0,34)	8,44	-	(0,72)	7,15	-	0,38	1,29
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1C	LU0290356871	(0,84)	(4,69)	3,43	(0,72)	(4,58)	3,53	(0,12)	(0,11)	(0,10)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0614173549	(0,84)	(4,69)	3,43	(0,72)	(4,58)	3,53	(0,12)	(0,11)	(0,10)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1C	LU0290356954	(1,38)	(10,22)	5,65	(1,24)	(10,12)	5,70	(0,14)	(0,10)	(0,05)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	1D	LU0614173895	(1,38)	(10,22)	5,65	(1,24)	(10,12)	5,70	(0,14)	(0,10)	(0,05)

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions à couverture contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, cette Catégorie d'actions a été lancée.

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - **non auditées (suite)**

8. Performance (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾⁽³⁾	LU2606231335	-	-	4,58	-	-	3,43	-	-	1,15
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾⁽³⁾	LU2606231418	-	-	4,26	-	-	3,43	-	-	0,83
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	1C	LU0290357176	(1,99)	(14,81)	7,10	(1,87)	(14,70)	7,18	(0,12)	(0,11)	(0,08)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1C	LU0290357259	(3,24)	(20,03)	9,07	(3,12)	(19,96)	9,12	(0,12)	(0,07)	(0,05)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	1D - GBP Hedged ⁽¹⁾⁽²⁾	LU2523865728	-	(0,69)	10,50	-	(0,98)	9,12	-	0,29	1,38
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾⁽²⁾	LU2523865991	-	(0,36)	11,40	-	(0,98)	9,12	-	0,62	2,28
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	1C	LU0290357507	(6,89)	(34,47)	10,49	(6,76)	(34,38)	10,62	(0,13)	(0,09)	(0,13)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	1C	LU0290357846	(10,33)	(40,78)	10,46	(10,18)	(40,68)	10,59	(0,15)	(0,10)	(0,13)
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽¹⁾	LU0290357929	4,34	(19,04)	2,01	10,95	(16,74)	1,91	(6,61)	(2,30)	0,10

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions à couverture contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, cette Catégorie d'actions a été lancée.

⁽³⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

8. Performance (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽¹⁾	LU0962078753	4,34	(19,04)	2,01	10,95	(16,74)	1,91	(6,61)	(2,30)	0,10
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾	LU0641007009	5,16	(17,14)	4,33	10,95	(16,74)	1,91	(5,79)	(0,40)	2,42
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged ⁽¹⁾	LU0641007264	5,05	(18,29)	3,42	10,95	(16,74)	1,91	(5,90)	(1,55)	1,51
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	4D - CHF Hedged ⁽¹⁾	LU0641007421	3,99	(19,35)	(0,08)	10,95	(16,74)	1,91	(6,96)	(2,61)	(1,99)
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	5C	LU0908508814	10,64	(16,88)	1,83	10,95	(16,74)	1,91	(0,31)	(0,14)	(0,08)
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	1C	LU0290358224	6,05	(9,79)	5,96	6,35	(9,66)	5,93	(0,30)	(0,13)	0,03
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	LU0290358497	(0,59)	(0,03)	3,27	(0,49)	0,07	3,37	(0,10)	(0,10)	(0,10)
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0335044896	(0,59)	(0,03)	3,27	(0,49)	0,07	3,37	(0,10)	(0,10)	(0,10)
Xtrackers II ITRAXX EUROPE SWAP UCITS ETF ⁽⁴⁾	1C	LU0290358653	0,26	(0,93)	0,79	0,44	(0,75)	0,93	(0,18)	(0,18)	(0,14)
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SWAP UCITS ETF ⁽⁴⁾	1C	LU0290359032	3,60	(4,92)	3,64	3,85	(4,69)	3,92	(0,25)	(0,23)	(0,28)
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	LU0321462870	(7,01)	2,02	(10,89)	(6,78)	2,26	(10,68)	(0,23)	(0,24)	(0,21)

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions à couverture contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽⁴⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été liquidé. Veuillez vous reporter à la section relative aux événements significatifs au cours de l'exercice des Notes aux États financiers du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - **non auditées (suite)**

8. Performance (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽¹⁾	LU0321462953	(3,94)	(21,22)	8,05	(2,43)	(19,25)	11,11	(1,51)	(1,97)	(3,06)
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽¹⁾⁽⁵⁾	LU2361257269	(0,51)	(21,25)	7,95	(0,10)	(19,25)	11,11	(0,41)	(2,00)	(3,16)
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2C	LU1920015440	(2,82)	(18,73)	10,81	(2,43)	(19,25)	11,11	(0,39)	0,52	(0,30)
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	2D	LU0677077884	(2,81)	(18,73)	10,79	(2,43)	(19,25)	11,11	(0,38)	0,52	(0,32)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	1C	LU0321463258	1,85	21,14	(1,37)	2,00	21,33	(1,22)	(0,15)	(0,19)	(0,15)
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0321463506	(2,32)	(13,20)	5,30	(2,17)	(13,07)	5,46	(0,15)	(0,13)	(0,16)
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1C	LU0321465469	(0,07)	1,56	5,06	0,08	1,71	5,21	(0,15)	(0,15)	(0,15)
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	1D	LU0321464652	(0,10)	1,24	4,55	0,05	1,40	4,69	(0,15)	(0,16)	(0,14)
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C - EUR Hedged ⁽¹⁾	LU0378818131	(3,24)	(15,34)	3,83	0,13	(13,31)	1,57	(3,37)	(2,03)	2,26
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D - EUR Hedged ⁽¹⁾	LU0690964092	(3,24)	(15,34)	3,85	0,13	(13,31)	1,57	(3,37)	(2,03)	2,28
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾	LU0641006290	(2,54)	(14,22)	5,25	0,13	(13,31)	1,57	(2,67)	(0,91)	3,68
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3C - USD Hedged ⁽¹⁾	LU0641006456	(2,47)	(13,51)	6,12	0,13	(13,31)	1,57	(2,60)	(0,20)	4,55
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged ⁽¹⁾	LU0641006613	(3,52)	(15,77)	1,69	0,13	(13,31)	1,57	(3,65)	(2,46)	0,12

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions à couverture contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽⁵⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2021, cette Catégorie d'actions a été lancée.

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - **non auditées (suite)**

8. Performance (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	5C	LU0908508731	(0,07)	(13,49)	1,41	0,13	(13,31)	1,57	(0,20)	(0,18)	(0,16)
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0378818560	(5,13)	(5,28)	3,44	(4,92)	(5,03)	3,67	(0,21)	(0,25)	(0,23)
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1C ⁽⁵⁾	LU1920015796	(0,47)	(12,99)	4,17	(0,47)	(12,95)	4,11	-	(0,04)	0,06
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	1D	LU0429459356	(2,53)	(13,00)	4,17	(2,47)	(12,95)	4,11	(0,06)	(0,05)	0,06
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2C - GBP Hedged ⁽¹⁾⁽³⁾	LU2610432036	-	-	(0,02)	-	-	0,37	-	-	(0,39)
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	2D - EUR Hedged ⁽¹⁾	LU1399300455	(3,40)	(14,94)	1,91	(2,47)	(12,95)	4,11	(0,93)	(1,99)	(2,20)
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1C ⁽⁵⁾	LU1920015523	(0,04)	(3,71)	4,28	(0,04)	(3,65)	4,32	-	(0,06)	(0,04)
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	1D	LU0429458895	(0,63)	(3,71)	4,28	(0,57)	(3,65)	4,32	(0,06)	(0,06)	(0,04)
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	LU0478205379	(1,10)	(13,78)	8,03	(0,97)	(13,65)	8,19	(0,13)	(0,13)	(0,16)
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	1D ⁽⁵⁾	LU0478205965	(0,45)	(13,79)	8,03	(0,41)	(13,65)	8,19	(0,04)	(0,14)	(0,16)
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0643975161	(2,76)	(17,94)	5,51	(2,62)	(17,86)	5,62	(0,14)	(0,08)	(0,11)
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU0468896575	(2,76)	(17,94)	5,51	(2,62)	(17,86)	5,62	(0,14)	(0,08)	(0,11)
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾⁽²⁾	LU2523866379	-	(0,76)	7,70	-	(1,41)	5,62	-	0,65	2,08
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾⁽²⁾	LU2523866296	-	(1,11)	7,19	-	(1,41)	5,62	-	0,30	1,57

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions à couverture contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, cette Catégorie d'actions a été lancée.

⁽³⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽⁵⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2021, cette Catégorie d'actions a été lancée.

8. Performance (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	1D	LU0468897110	(0,98)	(4,83)	2,68	(0,84)	(4,68)	2,81	(0,14)	(0,15)	(0,13)
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1C ⁽⁵⁾	LU0484968903	(0,46)	(13,67)	7,79	(0,42)	(13,46)	8,01	(0,04)	(0,21)	(0,22)
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	1D	LU0484968812	(1,15)	(13,67)	7,78	(0,98)	(13,46)	8,01	(0,17)	(0,21)	(0,23)
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0484969463	(2,96)	(18,49)	5,64	(2,82)	(18,37)	5,76	(0,14)	(0,12)	(0,12)
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1C	LU0524480265	(3,13)	(17,46)	8,11	(2,99)	(17,35)	8,27	(0,14)	(0,11)	(0,16)
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	1D	LU0962071741	(3,13)	(17,47)	8,11	(2,99)	(17,35)	8,27	(0,14)	(0,12)	(0,16)
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0494592974	(3,36)	(12,73)	4,45	(3,10)	(12,50)	4,74	(0,26)	(0,23)	(0,29)
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	1C	LU0613540268	(0,62)	(0,64)	3,01	(0,47)	(0,50)	3,13	(0,15)	(0,14)	(0,12)
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	1C	LU0820950128	(3,49)	(17,80)	5,89	(3,29)	(17,63)	6,11	(0,20)	(0,17)	(0,22)
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	1C	LU0925589839	(0,74)	(4,69)	3,80	(0,59)	(4,53)	3,96	(0,15)	(0,16)	(0,16)
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	2D ⁽³⁾	LU2552296563	-	-	3,05	-	-	3,20	-	-	(0,15)
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C	LU0952581584	(0,38)	(7,58)	0,33	(0,22)	(7,43)	0,48	(0,16)	(0,15)	(0,15)

⁽³⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, cette Catégorie d'actions a été lancée. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

⁽⁵⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2021, cette Catégorie d'actions a été lancée.

8. Performance (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	1D	LU0942970103	(4,85)	(17,08)	5,77	(4,71)	(16,75)	5,92	(0,14)	(0,33)	(0,15)
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	2C - USD Hedged ⁽¹⁾	LU0942970285	(1,59)	(12,51)	6,69	(1,39)	(16,75)	5,92	(0,20)	4,24	0,77
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	3D - GBP Hedged ⁽¹⁾	LU0942970368	(1,73)	(13,45)	5,92	(1,54)	(16,75)	5,92	(0,19)	3,30	-
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	4C - CHF Hedged ⁽¹⁾	LU0942970442	(2,69)	(14,99)	2,30	(2,49)	(16,75)	5,92	(0,20)	1,76	(3,62)
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	5C - EUR Hedged ⁽¹⁾	LU0942970798	(2,42)	(14,55)	4,43	(2,23)	(16,75)	5,92	(0,19)	2,20	(1,49)
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1C	LU1109943388	3,09	(9,62)	11,55	3,18	(9,41)	11,79	(0,09)	(0,21)	(0,24)
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	1D	LU1109942653	3,09	(9,62)	11,55	3,18	(9,41)	11,79	(0,09)	(0,21)	(0,24)
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	1D	LU1109939865	2,62	(4,82)	7,32	3,17	(4,48)	8,01	(0,55)	(0,34)	(0,69)
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D	LU1094612022	6,70	(5,82)	1,45	7,43	(5,62)	1,71	(0,73)	(0,20)	(0,26)
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	1C	LU2178481649	(0,42)	(7,02)	5,54	(0,15)	(6,80)	5,77	(0,27)	(0,22)	(0,23)
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1C ⁽²⁾	LU2462217071	-	(6,40)	2,94	-	(6,30)	3,15	-	(0,10)	(0,21)
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	1D ⁽⁵⁾	LU2385068163	(1,08)	(16,84)	2,93	(1,84)	(16,68)	3,15	0,76	(0,16)	(0,22)
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	2D - GBP Hedged ⁽¹⁾⁽⁵⁾	LU2385068247	(1,10)	(16,27)	5,46	(1,84)	(16,68)	3,15	0,74	0,41	2,31

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions à couverture contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽²⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, cette Catégorie d'actions a été lancée.

⁽⁵⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2021, cette Catégorie d'actions a été lancée.

8. Performance (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	3D - USD Hedged ⁽¹⁾⁽⁵⁾	LU2385068320	(1,09)	(15,43)	6,27	(1,84)	(16,68)	3,15	0,75	1,25	3,12
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	4D - EUR Hedged ⁽¹⁾⁽⁵⁾	LU2385068593	(1,16)	(17,28)	3,98	(1,84)	(16,68)	3,15	0,68	(0,60)	0,83
Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF ⁽⁶⁾	1C	LU2468423459	-	(6,01)	6,17	-	(5,94)	6,32	-	(0,07)	(0,15)
Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF ⁽⁶⁾	1C	LU2504532131	-	1,46	3,88	-	1,44	3,96	-	0,02	(0,08)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF ⁽⁶⁾	1D	LU2504532487	-	(0,95)	9,38	-	(0,93)	9,53	-	(0,02)	(0,15)
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF ⁽⁶⁾	1D	LU2504537445	-	(0,83)	6,82	-	(0,82)	6,94	-	(0,01)	(0,12)
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF ⁽⁷⁾	1D	LU2158769930	-	-	7,03	-	-	6,67	-	-	0,36
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽⁷⁾	1C	LU2641054122	-	-	1,12	-	-	1,10	-	-	0,02
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF ⁽⁷⁾	1C	LU2641053827	-	-	1,16	-	-	1,13	-	-	0,03
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽⁷⁾	1C	LU2641054551	-	-	1,02	-	-	1,01	-	-	0,01

⁽¹⁾ Pour les Catégories d'actions à couverture contre le risque de change :

« L'Écart de performance est défini comme la différence entre la performance de la Catégorie d'actions couverte contre le risque de change de ce Compartiment et l'Indice de référence sans couverture. »

⁽⁵⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2021, cette Catégorie d'actions a été lancée.

⁽⁶⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, ce Compartiment a été lancé.

⁽⁷⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Xtrackers II

Informations destinées aux Actionnaires - **non auditées (suite)**

8. Performance (suite)

Compartiment	Catégorie d'actions	Code ISIN	Performance du Compartiment (en %)			Performance de l'Indice répliqué (en %)			Écart de performance (en %)		
			2021	2022	2023	2021	2022	2023	2021	2022	2023
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁷⁾	1D	LU2673523218	-	-	3,35	-	-	3,33	-	-	0,02
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁷⁾	1D	LU2673523309	-	-	4,97	-	-	4,95	-	-	0,02
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁷⁾	1D	LU2673523481	-	-	6,01	-	-	6,04	-	-	(0,03)
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽⁷⁾	1D	LU2673523564	-	-	7,01	-	-	7,10	-	-	(0,09)
Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF ⁽⁷⁾	1D	LU2662649503	-	-	1,60	-	-	1,60	-	-	-
Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF ⁽⁷⁾	1D	LU2662649685	-	-	2,29	-	-	2,28	-	-	0,01
Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF ⁽⁷⁾	1D	LU2662649412	-	-	3,86	-	-	3,85	-	-	0,01

⁽⁷⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

La performance de chaque Catégorie d'actions correspond à la variation de la Valeur liquidative de la période en cours, ajustée de la distribution brute des Actions de distribution et exprimée dans la devise de la Catégorie d'actions.

Pour les Catégories d'actions présentées dans le tableau qui ont été lancées durant cet exercice, la performance a été calculée sur la première période depuis le lancement. La performance historique n'est pas un indicateur de la performance actuelle ou future ; les commissions et frais facturés pour l'émission et le rachat des parts ne sont pas pris en compte.

Publication périodique pour les produits visés aux Articles 8 et 9 dans le cadre du SFDR et du Règlement européen sur la taxinomie

Les informations suivantes ont été fournies conformément à l'Article 11 du Règlement (UE) 2019/2088 (la « Réglementation sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers » ou « SFDR »).

Les informations sont présentées ci-dessous à l'aide du modèle de normes techniques réglementaires (RTS) du SFDR (2023/363) pour les Compartiments de la Société qui : i) ont fait la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales ; ou ii) ont réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental ou social au 31 décembre 2023.

L'article du SFDR auquel chaque Compartiment de la Société a été soumis au regard des exigences en matière de publication dans le cadre du SFDR et du Règlement européen sur la taxinomie au cours de la période close le 31 décembre 2023 est présenté dans le tableau suivant.

Les investissements sous-jacents aux produits relevant de l'Article 6 ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Nom du Compartiment	Article SFDR
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 7-10 UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 15-30 UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 25+ UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II GLOBAL INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND SHORT DAILY SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II IBOXX GERMANY COVERED BOND SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II USD OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II GBP OVERNIGHT RATE SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II SINGAPORE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II US TREASURIES UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II US TREASURIES 1-3 UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 1-3 UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SRI PAB UCITS ETF	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE AAA GOVERNMENT BOND SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1

Xtrackers II

Nom du Compartiment	Article SFDR
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II AUSTRALIA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II ITALY GOVERNMENT BOND 0-1 SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUR COVERED BOND SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II JAPAN GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II ESG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1-3 SWAP UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II HARVEST CHINA GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUR CORPORATE BOND SHORT DURATION SRI PAB UCITS ETF	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II ESG GLOBAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II ESG EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II TIPS US INFLATION-LINKED BOND UCITS ETF	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT GREEN BOND UCITS ETF	Article 9, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND ESG TILTED UCITS ETF	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II J.P. MORGAN EM LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II EUROZONE GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II IBOXX EUROZONE GOVERNMENT BOND YIELD PLUS 0-1 UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II GERMANY GOVERNMENT BOND 0-1 UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2027 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2029 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2031 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II TARGET MATURITY SEPT 2033 EUR CORPORATE BOND UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 8, paragraphe 1
Xtrackers II US TREASURIES 3-7 UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II US TREASURIES 7-10 UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 6, paragraphe 1
Xtrackers II US TREASURIES 10+ UCITS ETF ⁽¹⁾	Article 6, paragraphe 1

⁽¹⁾ Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, ce Compartiment a été lancé. Veuillez vous reporter à la sous-section relative aux autres modifications apportées à la Société au cours de l'exercice, dans la section « Informations destinées aux Actionnaires » du présent rapport annuel pour plus d'informations.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II EUR Corporate Bond SRI PAB UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 549300HRJ2UNJWP1I674

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?	
●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de 25,87 % d'investissements durables (au 31/12/2023) <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate SRI PAB Index (l'« Indice de

référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier détenait un portefeuille de titres incluant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de référence était conçu pour représenter la performance du marché des obligations de sociétés à taux fixe libellées en euro de qualité « investment grade », à l'exclusion des obligations qui ne répondaient pas à des critères ESG spécifiques (environnementaux, sociaux et de gouvernance). L'Indice de référence visait à se conformer aux normes minimales établies pour le label EU PAB dans le Règlement PAB.

L'Indice de référence établissait une décarbonisation initiale de 50 % des émissions absolues de gaz à effet de serre (« GES ») par rapport à l'indice Bloomberg Euro Corporate Index (l'« Indice parent »), suivie d'une trajectoire annuelle de décarbonisation de 7 % des émissions absolues de GES. En outre, l'Indice de référence excluait les obligations qui ne respectaient pas certains critères ESG spécifiques.

Les obligations suivantes étaient notamment exclues de l'Indice de référence :

- Émetteurs pour lesquels MSCI n'avait pas déclaré ou estimé les émissions absolues de GES ;
- Titres non notés par MSCI ESG Research LLC ;
- Obligations émises par des émetteurs notés BB ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'une société par rapport à ses pairs dans son secteur et prenaient en compte plus de 30 questions environnementales, sociales et de gouvernance clés ;
- Émetteurs affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge » ou émetteurs ne respectant pas une notation de controverse environnementale selon MSCI. La notation MSCI ESG Controversies permettait d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail ;
- Émetteurs classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, le pétrole et le gaz, l'énergie et les armes nucléaires, et le charbon thermique ; et
- Émetteurs impliqués dans des armes controversées ou des réserves de combustibles fossiles.

Si, après application des critères d'exclusion ESG susmentionnés, moins de 20 % du nombre total d'émetteurs de l'univers des obligations éligibles (le « Seuil Pertinent ») étaient exclus, les émetteurs restants étaient classés en fonction de la notation MSCI ESG et de la notation MSCI ESG Controversies Score, et ceux étant classés le plus bas étaient exclus de l'Indice de référence, jusqu'à ce que le nombre d'émetteurs exclus soit supérieur au Seuil Pertinent.

Les données sur les émissions de GES de MSCI, les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) provenaient de MSCI ESG Research LLC.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Émissions totales de GES	La moyenne pondérée des émissions totales de GES des émetteurs du portefeuille du produit financier (Scope 1, Scope 2 et Scope 3), tel que déterminé par MSCI.	20 760 477,08
Exposition aux combustibles fossiles	Le pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée aux sociétés marquées comme impliquées dans les combustibles fossiles, tel que déterminé par MSCI, ce qui inclut les sociétés tirant leur chiffre d'affaires de l'extraction de charbon thermique, de l'extraction de pétrole et de gaz conventionnelle et non conventionnelle, du raffinage de pétrole, ainsi que leur chiffre d'affaires de la production d'énergie thermique à base de charbon, de la production d'énergie à base de combustible liquide ou de la production d'énergie à base de gaz naturel, ou les sociétés pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	1,12 %
Exposition à des controverses très graves	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés confrontées à une ou plusieurs controverses très graves en matière d'environnement, de clientèle, de droits de l'homme, de droits du travail et de gouvernance comme défini par MSCI, ce qui inclut les violations des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, ou les sociétés pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,76 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés notées « CCC », tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,76 %

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Indicateur (tel que décrit ci-dessus)	Performance (au 31/12/2022)	Performance (au 31/12/2023)
Émissions totales de GES	20 625 135,26	20 760 477,08

Exposition aux combustibles fossiles	1,93 %	1,12 %
Exposition à des controverses très graves	1,57 %	0,76 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	1,57 %	0,76 %

● ***Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?***

Bien que l'investissement durable n'ait pas été l'un des objectifs du produit financier, ce dernier investissait une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis par l'article 2(17) du SFDR.

Au 31 décembre 2023, 25,87 % de l'actif net du produit financier étaient investis dans des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne nuisent pas de manière significative à l'un de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements suivent des pratiques de bonne gouvernance. L'évaluation des investissements durables utilisait les données d'un ou de plusieurs fournisseurs de données et/ou sources publiques pour déterminer si une activité était durable. Les objectifs environnementaux et/ou sociaux étaient identifiés par des activités contribuant positivement aux Objectifs de développement durable des Nations unies (« ODD ») qui incluaient, notamment, (i) l'Objectif 1 : Pas de pauvreté, (ii) l'Objectif 2 : Faim « zéro », (iii) l'Objectif 3 : Bonne santé et bien-être, (iv) l'Objectif 4 : Éducation de qualité, (v) l'Objectif 5 : Égalité entre les sexes, (vi) l'Objectif 6 : Eau propre et assainissement (vii) l'Objectif 7 : Énergie propre et d'un coût abordable, (viii) l'Objectif 10 : Inégalités réduites, (ix) l'Objectif 11 : Villes et communautés durables, (x) l'Objectif 12 : Consommation et production durables, (xi) l'Objectif 13 : Mesures relatives à la lutte contre les changements climatiques, (xii) l'Objectif 14 : Vie aquatique et (xiii) l'Objectif 15 : Vie terrestre, étaient mesurés en termes de chiffre d'affaires, de dépenses d'investissement (CapEx) et/ou de dépenses d'exploitation (OpEx).

● ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Conformément à l'article 2(17) du SFDR, ces investissements durables ne devaient pas causer de préjudice important à des objectifs environnementaux ou sociaux, et ces émetteurs d'investissement durable devaient suivre des pratiques de bonne gouvernance. Tout investissement qui ne respectait pas les seuils liés au principe

consistant à ne pas causer de préjudice important n'était pas pris en compte dans la part d'investissement durable du produit financier. Ces seuils incluaient notamment :

- l'implication dans des activités commerciales causant un préjudice ;
- la violation de normes internationales ou l'implication dans des controverses très graves ; et
- la violation de certains seuils d'indicateurs de principales incidences négatives.

— — *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- empreinte carbone (n° 2) ;
- émissions de GES (Scope 1, Scope 2, Scope 3 et total) (n° 3) ;
- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- part de consommation et de production d'énergie non renouvelable (n° 5) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ; et
- exposition à des armes controversées (n° 14).

— — *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?*

Tout titre qui enfreignait les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme était exclu par l'Indice de référence du produit financier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- empreinte carbone (n° 2) ;
- émissions de GES (Scope 1, Scope 2, Scope 3 et total) (n° 3) ;
- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- part de consommation et de production d'énergie non renouvelable (n° 5) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ; et
- Exposition à des armes controversées (n° 14).

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier à la fin de chaque trimestre.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
DWS DEUTSCHE GL. LQ. RS. CL. Z	Autres / non classés	0,79 %	Irlande
CREDIT SUISSE GROUP AG RegS	Finance	0,17 %	Suisse
RABOBANK NEDERLAND NV	Finance	0,14 %	Pays-Bas
FRANCE TÉLÉCOM MTN	Télécommunications	0,14 %	France
MICROSOFT CORPORATION	Technologies de l'information	0,12 %	États-Unis

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 01/01/2023 au 31/12/2023

SANOFI SA MTN RegS	Santé	0,11 %	France
JPMORGAN CHASE & CO MTN RegS	Finance	0,11 %	États-Unis
VODAFONE GROUP PLC MTN RegS	Télécommunications	0,11 %	Royaume-Uni
BNP PARIBAS SA MTN RegS	Finance	0,11 %	France
AT&T INC	Télécommunications	0,11 %	États-Unis
AT&T INC	Télécommunications	0,11 %	États-Unis
NOVARTIS FINANCE SA RegS	Santé	0,11 %	Luxembourg
MORGAN STANLEY	Finance	0,11 %	États-Unis
CREDIT SUISSE GROUP AG MTN RegS	Finance	0,10 %	Suisse
CREDIT SUISSE GROUP AG MTN RegS	Finance	0,10 %	Suisse



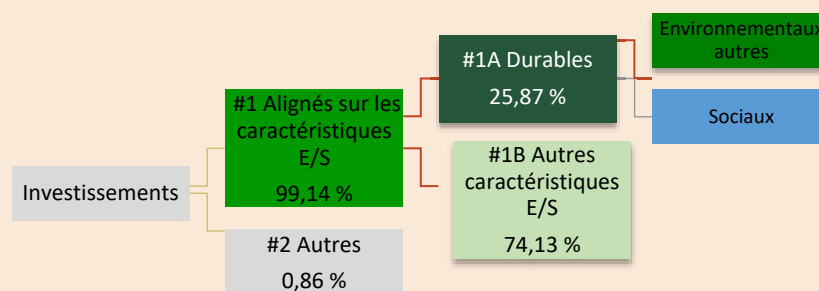
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● *Quelle était l'allocation des actifs ?*

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 99,14 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S). Dans cette catégorie, 25,87 % des actifs du produit financier étaient considérés comme des investissements durables (#1A Durables).

0,86 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par secteur GICS au 31 décembre 2023.

Secteur (GICS)	Actifs du produit financier
Finance	48,83 %
Industrie	10,97 %
Télécommunications	8,70 %
Santé	8,29 %
Consommation discrétionnaire	5,77 %
Immobilier	5,64 %
Matériaux	3,84 %
Technologies de l'information	3,39 %
Biens de consommation de base	3,10 %
Services aux collectivités	1,37 %
Autres / non classés	0,10 %
Énergie	0,00 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile nucléaire** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

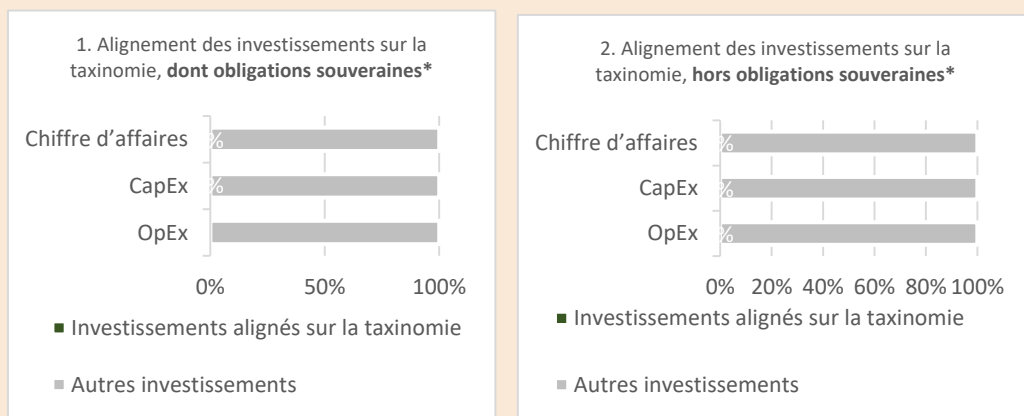
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 25,87 %.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif social. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 25,87 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts assortis ou non de sûretés (liquidités) et des actions d'autres organismes de placement collectif qui suivaient une stratégie de marché monétaire au 31 décembre 2023. Il a également inclus des titres qui ont été récemment rétrogradés par le fournisseur de données ESG concerné, mais qui n'ont pas pu être retirés de l'Indice de référence avant son prochain rééquilibrage et qui n'avaient donc pas pu être retirés du portefeuille jusqu'à cette date.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en s'efforçant de se conformer aux normes minimales établies pour le label EU PAB dans le Règlement PAB. L'Indice de référence établissait une décarbonisation initiale de 50 % des émissions absolues de gaz à effet de serre (« GES ») par rapport à l'Indice parent, suivie d'une trajectoire annuelle de décarbonisation de 7 % des émissions absolues de GES. En outre, l'Indice de référence excluait les obligations ne répondant pas à des critères ESG spécifiques (environnementaux, sociaux et de gouvernance). Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs bénéficiaires des investissements, destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement et une Politique de gouvernance d'entreprise et de vote par procuration. Pour de plus amples informations concernant les activités de vote par procuration du produit financier, veuillez consulter le site <https://funds.dws.com/en-lu/about-us/corporate-governance/>.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate SRI PAB Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice de référence établira une décarbonisation initiale de 50 % des émissions absolues de gaz à effet de serre (« GES ») par rapport à l'Indice parent, à savoir l'indice de marché large pertinent, suivie d'une trajectoire annuelle de décarbonisation de 7 % des émissions absolues de GES. En outre, l'Indice de référence exclura les obligations qui ne répondent pas à des critères ESG spécifiques (environnementaux, sociaux et de gouvernance).

Les obligations suivantes seront notamment exclues de l'Indice de référence :

- Émetteurs pour lesquels MSCI n'a pas déclaré ou estimé les émissions absolues de GES ;
- Titres non notés par MSCI ESG Research LLC ;
- Obligations émises par des émetteurs notés BB ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'une société par rapport à ses pairs dans son secteur et

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

prennent en compte plus de 30 questions environnementales, sociales et de gouvernance clés ;

- Émetteurs affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge » ou émetteurs qui ne respectent pas une notation de controverse environnementale selon MSCI. La notation MSCI ESG Controversies permet d’identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s’y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l’homme et la Déclaration de l’OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail ;
- Émetteurs classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l’implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s’y limiter, l’alcool, le tabac, les jeux d’argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, le pétrole et le gaz, l’énergie et les armes nucléaires, et le charbon thermique ; et
- Émetteurs impliqués dans des armes controversées ou des réserves de combustibles fossiles.

Si, après application des critères d’exclusion ESG susmentionnés, moins de 20 % du nombre total d’émetteurs de l’univers des obligations éligibles (le « Seuil Pertinent ») sont exclus, les émetteurs restants seront classés en fonction de la notation MSCI ESG Ratings et de la notation MSCI ESG Controversies Score, et ceux étant classés le plus bas seront exclus de l’Indice de référence, jusqu’à ce que le nombre d’émetteurs exclus soit supérieur au Seuil Pertinent.

Les données sur les émissions de GES de MSCI, les notations de MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et la recherche sur l’implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) proviennent de MSCI ESG Research LLC.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l’alignement de l’indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l’indice de référence (au 31/12/2023)
Émissions totales de GES	20 760 477,08	20 695 054,03
Exposition aux combustibles fossiles	1,12 %	1,12 %
Exposition à des controverses très graves	0,76 %	0,77 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	0,76 %	0,77 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	7,79 %	8,01 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	7,79 %	7,54 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II ESG Global Aggregate Bond UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 549300BLVKFY3X3CSM08

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de 9,05 % d'investissements durables (au 31/12/2023)</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif social <p><input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables</p>

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice Bloomberg MSCI Global Aggregate Sustainable and SRI Currency Neutral Index (l'« Indice de référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier détenait un portefeuille de titres

incluant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées. L'Indice de référence était conçu pour représenter la performance d'ensemble des marchés internationaux des obligations à taux fixe notées « investment grade ».

L'Indice de référence se basait sur l'indice Bloomberg Global Aggregate Index (l'« Indice parent »). L'Indice de référence appliquait des critères à l'Indice parent. L'Indice de référence excluait avant tout les émetteurs dont les notations MSCI ESG étaient insuffisantes. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés. En outre, l'Indice de référence excluait les émetteurs (en particulier les sociétés) (i) impliqués dans des activités commerciales non conformes à certains critères de responsabilité sociale selon la méthodologie MSCI ESG Business Involvement Screening Research, ou (ii) considérés comme très controversés selon la méthodologie MSCI ESG Controversies. MSCI ESG Controversies permettait d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies. MSCI Business Involvement Screening Research permettait d'identifier les émetteurs en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, le pétrole et le gaz conventionnels et l'énergie nucléaire. Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores (notes de controverse selon MSCI ESG) et la recherche Business Involvement Screening Research provenaient de MSCI ESG Research LLC (<http://www.msci.com>).

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés notées « CCC », tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune données n'étaient disponibles. La couverture de cet indicateur de durabilité était limitée à la part entreprise du portefeuille du produit financier.	3,69 %
Score ESG du gouvernement	moyenne pondérée du score ESG (environnemental, social et de gouvernance) souverain global de la valeur de marché du portefeuille du produit financier qui permet d'évaluer la performance globale d'un émetteur national/d'une zone géographique en termes de facteurs de risques environnementaux tels que mesurés par MSCI. La couverture de cet indicateur de durabilité était limitée à la part gouvernementale du portefeuille du produit financier.	6,31
Exposition à des controverses très graves	pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés confrontées à une ou plusieurs controverses très graves en matière	3,47 %

	d'environnement, de clientèle, de droits de l'homme, de droits du travail et de gouvernance, comme déterminé par MSCI, ce qui inclut les violations du Pacte mondial des Nations unies ainsi que des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, ou les sociétés pour lesquelles aucune données n'étaient disponibles. La couverture de cet indicateur de durabilité était limitée à la part entreprise du portefeuille du produit financier.	
--	---	--

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Indicateur (tel que décrit ci-dessus)	Performance (au 31/12/2022)	Performance (au 31/12/2023)
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	3,51 %	3,69 %
Score ESG du gouvernement	6,51	6,31
Exposition à des controverses très graves	3,47 %	3,47 %

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Bien que l'investissement durable n'ait pas été l'un des objectifs du produit financier, ce dernier investissait une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis par l'article 2(17) du SFDR.

Au 31 décembre 2023, 9,05 % des actifs nets du produit financier étaient investis dans des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne nuisent pas de manière significative à l'un de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements suivent des pratiques de bonne gouvernance. L'évaluation des investissements durables utilisait les données d'un ou de plusieurs fournisseurs de données et/ou sources publiques pour déterminer si une activité était durable. Les objectifs environnementaux et/ou sociaux étaient identifiés par des activités contribuant positivement aux Objectifs de développement durable des Nations unies (« ODD ») qui incluaient, notamment, (i) l'Objectif 1 : Pas de pauvreté, (ii) l'Objectif 2 : Faim « zéro », (iii) l'Objectif 3 : Bonne santé et bien-être, (iv) l'Objectif 4 : Éducation de qualité, (v) l'Objectif 5 : Égalité entre les sexes, (vi) l'Objectif 6 : Eau propre et assainissement (vii) l'Objectif 7 : Énergie propre et d'un coût abordable, (viii) l'Objectif 10 : Inégalités réduites, (ix) l'Objectif 11 : Villes et communautés durables, (x)

l'Objectif 12 : Consommation et production durables, (xi) l'Objectif 13 : Mesures relatives à la lutte contre les changements climatiques, (xii) l'Objectif 14 : Vie aquatique et (xiii) l'Objectif 15 : Vie terrestre, étaient mesurés en termes de chiffre d'affaires, de dépenses d'investissement (CapEx) et/ou de dépenses d'exploitation (OpEx).

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Conformément à l'article 2(17) du SFDR, ces investissements durables ne devaient pas causer de préjudice important à des objectifs environnementaux ou sociaux, et ces émetteurs d'investissement durable devaient suivre des pratiques de bonne gouvernance. Tout investissement qui ne respectait pas les seuils liés au principe consistant à ne pas causer de préjudice important n'était pas pris en compte dans la part d'investissement durable du produit financier. Ces seuils incluaient notamment :

- l'implication dans des activités commerciales causant un préjudice ;
- la violation de normes internationales ou l'implication dans des controverses très graves ; et
- la violation de certains seuils d'indicateurs de principales incidences négatives.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres pertinents qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et
- pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (n° 16).

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?

Tout titre de société qui enfreignait les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme était exclu par l'Indice de référence du produit financier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et
- pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (n° 16).

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier à la fin de chaque trimestre.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
DEUTSCHE MANAGED DOLLAR FUND	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	1,01 %	Irlande
FNMA 30YR UMBS	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,30 %	États-Unis
FNMA 30YR UMBS	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,20 %	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 01/01/2023 au 31/12/2023

FNMA 30YR UMBS	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,20 %	États-Unis
BON DU TRÉSOR (2OLD)	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,19 %	États-Unis
BON DU TRÉSOR (OTR)	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,18 %	États-Unis
BON DU TRÉSOR	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,17 %	États-Unis
BON DU TRÉSOR (OLD)	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,17 %	États-Unis
BON DU TRÉSOR	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,17 %	États-Unis
BON DU TRÉSOR (OTR)	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,17 %	États-Unis
BON DU TRÉSOR	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,17 %	États-Unis
DWS DEUTSCHE GL. LQ. RS. CL. Z	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,16 %	Irlande
FNMA 30YR UMBS	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,16 %	États-Unis
BON DU TRÉSOR	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,16 %	États-Unis
GNMA2 30YR	Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	0,15 %	États-Unis



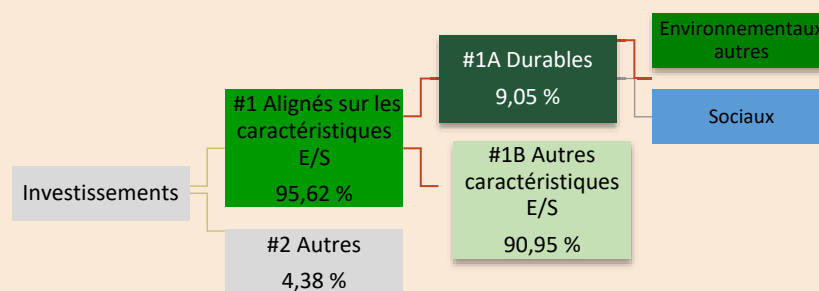
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 95,62 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S). Dans cette catégorie, 9,05 % des actifs du produit financier étaient considérés comme des investissements durables (#1A Durables).

4,38 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par secteur GICS au 31 décembre 2023.

Secteur (GICS)	Actifs du produit financier
Autres obligations/Obligations non classées ou d'État	61,32 %
Finance	26,41 %
Santé	2,14 %
Consommation discrétionnaire	1,87 %
Télécommunications	1,77 %
Industrie	1,57 %
Technologies de l'information	1,42 %
Immobilier	1,10 %
Biens de consommation de base	1,10 %
Matériaux	0,52 %
Énergie	0,41 %
Services aux collectivités	0,38 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

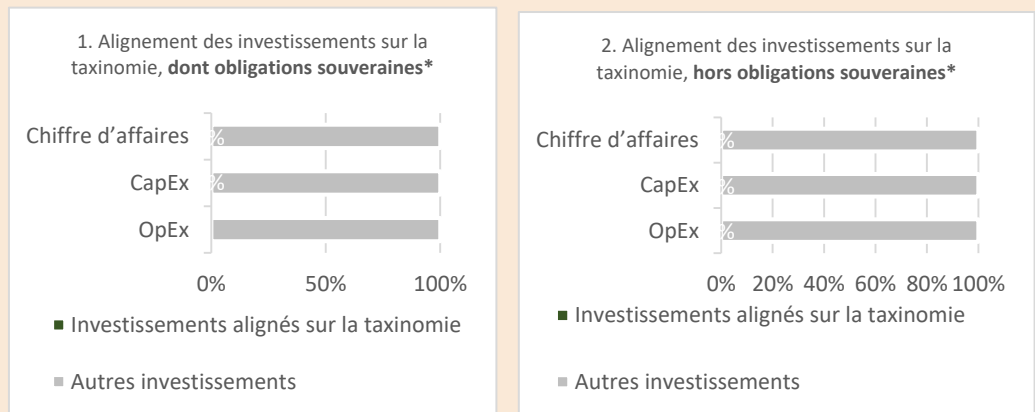
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

● Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 9,05 %.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif social. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 9,05 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts assortis ou non de sûretés (liquidités) et des actions d'autres organismes de placement collectif qui suivaient une stratégie de marché monétaire au 31 décembre 2023. Il a également inclus des titres qui ont été récemment rétrogradés par le fournisseur de données ESG concerné, mais qui n'ont pas pu être retirés de l'Indice de référence avant son prochain rééquilibrage et qui n'avaient donc pas pu être retirés du portefeuille jusqu'à cette date.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en excluant les composants de l'Indice parent qui ne répondaient pas aux critères ESG spécifiques décrits ci-dessus à chaque rééquilibrage de l'Indice de référence. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs, qui s'appuie sur le vote par procuration et l'engagement destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement et une Politique de gouvernance d'entreprise et de vote par procuration. Pour de plus amples informations concernant les activités de vote par procuration du produit financier, veuillez consulter le site <https://funds.dws.com/en-lu/about-us/corporate-governance/>.



Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice Bloomberg MSCI Global Aggregate Sustainable and SRI Currency Neutral Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

L'Indice de référence est basé sur l'Indice parent, qui est conçu pour refléter le marché mondial de la dette à taux fixe de qualité « investment grade ».

L'Indice de référence applique des critères à l'Indice parent. L'Indice de référence exclut avant tout les émetteurs dont les notations MSCI ESG sont insuffisantes. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés. En outre, l'Indice de référence exclut les émetteurs (en particulier les sociétés) (i) qui sont impliqués dans des activités commerciales qui ne sont pas conformes à certains critères de responsabilité sociale selon la méthodologie MSCI ESG Business Involvement Screening Research, ou (ii) qui sont considérés comme très controversés selon la méthodologie MSCI ESG Controversies. La notation MSCI ESG Controversies permet d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies. MSCI Business Involvement Screening Research permet d'identifier les émetteurs qui violent certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, le pétrole et le gaz conventionnels et l'énergie nucléaire. Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores (notes de controverse selon MSCI ESG) et la recherche Business Involvement Screening Research proviennent de MSCI ESG Research LLC (<http://www.msci.com>).

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	3,69 %	4,99 %
Score ESG du gouvernement	6,31	6,31
Exposition à des controverses très graves	3,47 %	4,83 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	5,77 %	5,92 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	5,77 %	5,39 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II EUR Corporate Bond Short Duration SRI PAB UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 254900K0IMZDD09CXS95

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %



Non



Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de 24,32 % d'investissements durables (au 31/12/2023)



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate SRI 0-5 Year PAB Index (l'« Indice de

référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier détenait un portefeuille de titres incluant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de référence était conçu pour représenter la performance des obligations de sociétés à taux fixe, libellées en euro, de qualité « investment grade » et possédant une échéance résiduelle d'au moins 1 mois et de moins de 5 ans, à l'exclusion des obligations qui ne satisfaisaient pas des critères ESG spécifiques (environnementaux, sociaux et de gouvernance). L'Indice de référence visait à se conformer aux normes minimales établies pour le label EU PAB dans le Règlement PAB.

L'Indice de référence établissait une décarbonisation initiale de 50 % des émissions absolues de gaz à effet de serre (« GES ») par rapport à l'indice Bloomberg Euro Corporate 0-5 Year Index (l'« Indice parent »), suivie d'une trajectoire annuelle de décarbonisation de 7 % des émissions absolues de GES. En outre, l'Indice de référence excluait les obligations qui ne respectaient pas certains critères ESG spécifiques.

Les obligations suivantes étaient notamment exclues de l'Indice de référence :

- Émetteurs pour lesquels MSCI n'avait pas déclaré ou estimé les émissions absolues de GES ;
- Titres non notés par MSCI ESG Research LLC ;
- Obligations émises par des émetteurs notés BB ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'une société par rapport à ses pairs dans son secteur et prenaient en compte plus de 30 questions environnementales, sociales et de gouvernance clés ;
- Émetteurs affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge » ou émetteurs ne respectant pas une notation de controverse environnementale selon MSCI. La notation MSCI ESG Controversies permettait d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail ;
- Émetteurs classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, le pétrole et le gaz, l'énergie et les armes nucléaires, et le charbon thermique ; et
- Émetteurs impliqués dans des armes controversées ou des réserves de combustibles fossiles.

Si, après application des critères d'exclusion ESG susmentionnés, moins de 20 % du nombre total d'émetteurs de l'univers des obligations éligibles (le « Seuil Pertinent ») étaient exclus, les émetteurs restants étaient classés en fonction de la notation MSCI ESG et de la notation MSCI ESG Controversies Score, et ceux étant classés le plus bas étaient exclus de l'Indice de référence, jusqu'à ce que le nombre d'émetteurs exclus soit supérieur au Seuil Pertinent.

Les données sur les émissions de GES de MSCI, les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) provenaient de MSCI ESG Research LLC.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Émissions totales de GES	La moyenne pondérée des émissions totales de GES des émetteurs du portefeuille du produit financier (Scope 1, Scope 2 et Scope 3), tel que déterminé par MSCI.	21 837 299,08
Exposition aux combustibles fossiles	Le pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée aux sociétés marquées comme impliquées dans les combustibles fossiles, tel que déterminé par MSCI, ce qui inclut les sociétés tirant leur chiffre d'affaires de l'extraction de charbon thermique, de l'extraction de pétrole et de gaz conventionnelle et non conventionnelle, du raffinage de pétrole, ainsi que leur chiffre d'affaires de la production d'énergie thermique à base de charbon, de la production d'énergie à base de combustible liquide ou de la production d'énergie à base de gaz naturel, ou les sociétés pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	1,68 %
Exposition à des controverses très graves	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés confrontées à une ou plusieurs controverses très graves en matière d'environnement, de clientèle, de droits de l'homme, de droits du travail et de gouvernance comme défini par MSCI, ce qui inclut les violations des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, ou les sociétés pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	1,26 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés notées « CCC », tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	1,26 %

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Indicateur (tel que décrit ci-dessus)	Performance (au 31/12/2022)	Performance (au 31/12/2023)
Émissions totales de GES	21 992 452,24	21 837 299,08

Exposition aux combustibles fossiles	1,96 %	1,68 %
Exposition à des controverses très graves	1,73 %	1,26 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	1,73 %	1,26 %

● ***Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?***

Bien que l'investissement durable n'ait pas été l'un des objectifs du produit financier, ce dernier investissait une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis par l'article 2(17) du SFDR.

Au 31 décembre 2023, 24,32 % des actifs nets du produit financier étaient investis dans des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne nuisent pas de manière significative à l'un de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements suivent des pratiques de bonne gouvernance. L'évaluation des investissements durables utilisait les données d'un ou de plusieurs fournisseurs de données et/ou sources publiques pour déterminer si une activité était durable. Les objectifs environnementaux et/ou sociaux étaient identifiés par des activités contribuant positivement aux Objectifs de développement durable des Nations unies (« ODD ») qui incluaient, notamment, (i) l'Objectif 1 : Pas de pauvreté, (ii) l'Objectif 2 : Faim « zéro », (iii) l'Objectif 3 : Bonne santé et bien-être, (iv) l'Objectif 4 : Éducation de qualité, (v) l'Objectif 5 : Égalité entre les sexes, (vi) l'Objectif 6 : Eau propre et assainissement (vii) l'Objectif 7 : Énergie propre et d'un coût abordable, (viii) l'Objectif 10 : Inégalités réduites, (ix) l'Objectif 11 : Villes et communautés durables, (x) l'Objectif 12 : Consommation et production durables, (xi) l'Objectif 13 : Mesures relatives à la lutte contre les changements climatiques, (xii) l'Objectif 14 : Vie aquatique et (xiii) l'Objectif 15 : Vie terrestre, étaient mesurés en termes de chiffre d'affaires, de dépenses d'investissement (CapEx) et/ou de dépenses d'exploitation (OpEx).

● ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Conformément à l'article 2(17) du SFDR, ces investissements durables ne devaient pas causer de préjudice important à des objectifs environnementaux ou sociaux, et ces émetteurs d'investissement durable devaient suivre des pratiques de bonne gouvernance. Tout investissement qui ne respectait pas les seuils liés au principe

consistant à ne pas causer de préjudice important n'était pas pris en compte dans la part d'investissement durable du produit financier. Ces seuils incluaient notamment :

- l'implication dans des activités commerciales causant un préjudice ;
- la violation de normes internationales ou l'implication dans des controverses très graves ; et
- la violation de certains seuils d'indicateurs de principales incidences négatives.

— — *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- empreinte carbone (n° 2) ;
- émissions de GES (Scope 1, Scope 2, Scope 3 et total) (n° 3) ;
- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- part de consommation et de production d'énergie non renouvelable (n° 5) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ; et
- exposition à des armes controversées (n° 14).

— — *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?*

Tout titre qui enfreignait les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme était exclu par l'Indice de référence du produit financier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- empreinte carbone (n° 2) ;
- émissions de GES (Scope 1, Scope 2, Scope 3 et total) (n° 3) ;
- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- part de consommation et de production d'énergie non renouvelable (n° 5) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ; et
- exposition à des armes controversées (n° 14).



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier à la fin de chaque trimestre.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
DWS DEUTSCHE GL. LQ. RS. CL. Z	Autres / non classés	0,42 %	Irlande
CREDIT SUISSE GROUP AG RegS	Finance	0,22 %	Suisse
RABOBANK NEDERLAND NV	Finance	0,18 %	Pays-Bas
VODAFONE GROUP PLC MTN RegS	Télécommunications	0,18 %	Royaume-Uni

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 01/01/2023 au 31/12/2023

DEUTSCHE BANK AG MTN RegS	Finance	0,17 %	Allemagne
AT&T INC	Télécommunications	0,16 %	États-Unis
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD RegS	Santé	0,15 %	Japon
SANOFI MTN RegS	Santé	0,15 %	France
SANOFI SA MTN RegS	Santé	0,14 %	France
ESSILORLUXOTTICA SA MTN RegS	Santé	0,14 %	France
AT&T INC	Télécommunications	0,14 %	États-Unis
ABBVIE INC	Santé	0,14 %	États-Unis
MEDTRONIC LUXEMBOURG GLOBAL HOLDIN	Santé	0,14 %	Luxembourg
RICHEMONT INTERNATIONAL HOLDING SA RegS	Consommation discrétionnaire	0,14 %	Luxembourg
BNP PARIBAS SA MTN RegS	Finance	0,14 %	France



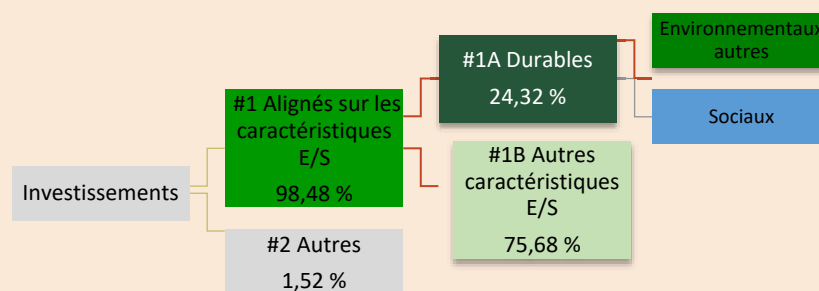
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● *Quelle était l'allocation des actifs ?*

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 98,48 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S). Dans cette catégorie, 24,32 % des actifs du produit financier étaient considérés comme des investissements durables (#1A Durables).

1,52 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par secteur GICS au 31 décembre 2023.

Secteur (GICS)	Actifs du produit financier
Finance	50,79 %
Industrie	10,25 %
Santé	7,90 %
Télécommunications	7,60 %
Consommation discrétionnaire	6,32 %
Matériaux	4,43 %
Immobilier	4,20 %
Biens de consommation de base	3,60 %
Technologies de l'information	3,43 %
Services aux collectivités	1,22 %
Autres / non classés	0,25 %
Énergie	0,00 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

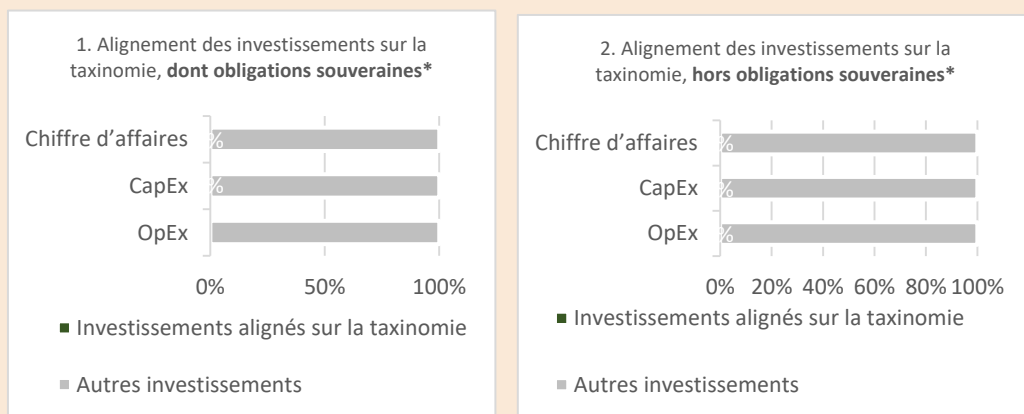
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 24,32 %.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif social. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 24,32 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts assortis ou non de sûretés (liquidités) et des actions d'autres organismes de placement collectif qui suivaient une stratégie de marché monétaire au 31 décembre 2023. Il a également inclus des titres qui ont été récemment rétrogradés par le fournisseur de données ESG concerné, mais qui n'ont pas pu être retirés de l'Indice de référence avant son prochain rééquilibrage et qui n'avaient donc pas pu être retirés du portefeuille jusqu'à cette date.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en s'efforçant de se conformer aux normes minimales établies pour le label EU PAB dans le Règlement PAB. L'Indice de référence établissait une décarbonisation initiale de 50 % des émissions absolues de gaz à effet de serre (« GES ») par rapport à l'Indice parent, suivie d'une trajectoire annuelle de décarbonisation de 7 % des émissions absolues de GES. En outre, l'Indice de référence excluait les obligations ne répondant pas à des critères ESG spécifiques (environnementaux, sociaux et de gouvernance). Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs bénéficiaires des investissements, destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement et une Politique de gouvernance d'entreprise et de vote par procuration. Pour de plus amples informations concernant les activités de vote par procuration du produit financier, veuillez consulter le site <https://funds.dws.com/en-lu/about-us/corporate-governance/>.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate SRI 0-5 Year PAB Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice de référence établira une décarbonisation initiale de 50 % des émissions absolues de gaz à effet de serre (« GES ») par rapport à l'Indice parent, à savoir l'indice de marché large pertinent, suivie d'une trajectoire annuelle de décarbonisation de 7 % des émissions absolues de GES. En outre, l'Indice de référence exclura les obligations qui ne répondent pas à des critères ESG spécifiques (environnementaux, sociaux et de gouvernance).

Les obligations suivantes seront notamment exclues de l'Indice de référence :

- Émetteurs pour lesquels MSCI n'a pas déclaré ou estimé les émissions absolues de GES ;
- Titres non notés par MSCI ESG Research LLC ;
- Obligations émises par des émetteurs notés BB ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'une société par rapport à ses pairs dans son secteur et

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

prennent en compte plus de 30 questions environnementales, sociales et de gouvernance clés ;

- Émetteurs affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge » ou émetteurs qui ne respectent pas une notation de controverse environnementale selon MSCI. La notation MSCI ESG Controversies permet d’identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s’y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l’homme et la Déclaration de l’OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail ;
- Émetteurs classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l’implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s’y limiter, l’alcool, le tabac, les jeux d’argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, le pétrole et le gaz, l’énergie et les armes nucléaires, et le charbon thermique ; et
- Émetteurs impliqués dans des armes controversées ou des réserves de combustibles fossiles.

Si, après application des critères d’exclusion ESG susmentionnés, moins de 20 % du nombre total d’émetteurs de l’univers des obligations éligibles (le « Seuil Pertinent ») sont exclus, les émetteurs restants seront classés en fonction de la notation MSCI ESG Ratings et de la notation MSCI ESG Controversies Score, et ceux étant classés le plus bas seront exclus de l’Indice de référence, jusqu’à ce que le nombre d’émetteurs exclus soit supérieur au Seuil Pertinent.

Les données sur les émissions de GES de MSCI, les notations de MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et la recherche sur l’implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) proviennent de MSCI ESG Research LLC.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l’alignement de l’indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l’indice de référence (au 31/12/2023)
Émissions totales de GES	21 837 299,08	21 769 142,73
Exposition aux combustibles fossiles	1,68 %	1,66 %
Exposition à des controverses très graves	1,26 %	1,24 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	1,26 %	1,24 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	5,54 %	5,77 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	5,54 %	5,75 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II ESG Global Government Bond UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 254900DOBENWQS9YME93

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Oui	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de ___ % d'investissements durables (au 31/12/2023) <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice FTSE ESG Select World Government Bond Index – DM (l'« Indice de référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier détenait un portefeuille de titres comprenant des composants de l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de

référence était conçu pour représenter la performance des obligations souveraines à taux fixe, classées dans la catégorie « investment grade », libellées dans la devise locale et émises sur des marchés développés, à l'exclusion des pays qui ne remplissaient pas des critères ESG (environnementaux, sociaux et de gouvernance) spécifiques.

L'Indice de référence déterminait ses composants en appliquant certains critères ESG dérivés de la série d'indices FTSE ESG Government Bond Index. Les pondérations des composants étaient ajustées dans l'Indice de référence par rapport à l'indice FTSE World Government Bond Index – DM (l'« Indice parent ») en surpondérant les pays présentant des résultats ESG plus élevés et en sous-pondérant les pays ayant des résultats ESG inférieurs avant d'appliquer certains autres critères d'inclusion aux composants de l'Indice parent. La pondération de la valeur de marché de chaque titre était « inclinée » par le score ESG de son pays respectif, de sorte que la pondération de chaque émetteur dans l'Indice de référence soit fonction de la pondération de la valeur de marché et du score ESG du pays.

Scores ESG

Les scores ESG des pays étaient calculés en fonction des pays figurant dans l'Indice parent. Ces scores ESG étaient destinés à évaluer l'exposition d'un pays à certains facteurs de risque ESG et la gestion de ces derniers, déterminés par le profil de durabilité du contrôleur de risque souverain Beyond Ratings. Beyond Ratings est un fournisseur de données intelligentes et d'analyses pour l'intégration (ESG) dans les obligations à revenu fixe. De plus amples informations sont disponibles à l'adresse :

https://content.ftserussell.com/sites/default/files/sovereign_risk_monitor_methodology_final_0.pdf

Les scores ESG de chaque pays étaient établis en évaluant et en notant la performance de chaque pays selon les trois piliers suivants :

- la performance environnementale : s'appuyait sur des sujets tels que l'énergie, le climat et les ressources ;
- la performance sociale : s'appuyait sur des sujets tels que l'inégalité, l'emploi, le capital humain, la santé et le bien-être de la société ; et
- la performance de gouvernance : s'appuyait sur des sujets tels que la corruption, l'efficacité du gouvernement, la stabilité politique, la qualité de la réglementation, l'état de droit, la voix et la responsabilité.

Ces scores de piliers étaient ensuite comparés, sur une base relative, à ceux d'autres pays de l'univers de l'Indice de référence avec un « facteur d'inclinaison » spécifique appliqué à chaque score de pilier. Les scores de piliers obtenus étaient ensuite combinés pour obtenir un seul et unique score ESG combiné pour chaque pays.

Les scores ESG des pays étaient ensuite appliqués pour recalculer la pondération de la valeur de marché de chaque pays dans l'Indice de référence par rapport à l'Indice parent afin de fournir une exposition plus élevée aux pays ayant un score ESG plus élevé et une exposition plus faible aux pays ayant un score ESG plus faible.

Pour plus d'informations sur les piliers ESG, les indicateurs ESG sous-jacents et la méthodologie d'« inclinaison » ESG, reportez-vous aux règles de base de la série d'indices FTSE ESG Government Bond Index.

https://research.ftserussell.com/products/downloads/FTSE_ESG_Government_Bond_Index_Series_Ground_Rules.pdf

Critères d'inclusion des pays

Une autre évaluation des critères d'inclusion des pays était ensuite effectuée en classant les pays en fonction de leur score ESG. Les pays identifiés comme retardataires significatifs (c'est-à-dire classés dans un certain centile le plus bas) étaient retirés de l'Indice de référence. Pour plus d'informations sur les seuils d'exclusion, reportez-vous aux règles de base de l'indice FTSE ESG Select World Government Bond Index – DM.

https://www.lseg.com/content/dam/ftse-russell/en_us/documents/ground-rules/ftse-esg-select-government-bond-index-series-ground-rules.pdf

Critères de liberté

L'Indice de référence appliquait également des critères d'inclusion supplémentaires basés sur les données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. Seuls les pays classés « libres » pouvaient être inclus dans l'Indice de référence. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>. Pour plus de détails, reportez-vous aux règles de base de l'indice FTSE ESG Select World Government Bond Index – DM.

https://www.lseg.com/content/dam/ftse-russell/en_us/documents/ground-rules/ftse-esg-select-government-bond-index-series-ground-rules.pdf

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Score Freedom House	moyenne pondérée du score de la valeur de marché du portefeuille du produit financier calculée selon le processus de classification et de notation « Liberté dans le monde » de Freedom House.	90,34
Score de pilier environnemental d'un pays	moyenne pondérée du score de risque environnemental souverain de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques environnementaux tels que mesurés par MSCI.	4,88
Score de pilier social d'un pays	moyenne pondérée du score de risque social souverain de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques sociaux tels que mesurés par MSCI.	7,52
Score de pilier de gouvernance d'un pays	moyenne pondérée du score de risque de gouvernance souveraine de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques de gouvernance, tels que mesurés par MSCI.	6,95

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur (tel que décrit ci-dessus)	Performance (au 31/12/2022)	Performance (au 31/12/2023)
Score Freedom House	89,43	90,34
Score de pilier environnemental d'un pays	5,21	4,88
Score de pilier social d'un pays	8,02	7,52
Score de pilier de gouvernance d'un pays	6,84	6,95

● ***Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?***

S/O. Le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a donc pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne causent pas de préjudice important à l'un de ces objectifs et que les émetteurs suivent des pratiques de bonne gouvernance.

● ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

— ***Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?***

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et qu'il investissait uniquement dans de la dette souveraine, aucun indicateur d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité n'avait été pris en compte afin de déterminer quelles activités économiques durables contribuaient à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

— ***Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?***

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

L'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (n° 16).



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 01/01/2023 au 31/12/2023

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier à la fin de chaque trimestre.

Investissements les plus importants	Type de titre	% d'actifs	Pays
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,51 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,49 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,47 %	France

FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,46 %	France
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND RegS	Obligations d'État	0,46 %	Allemagne
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,45 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,45 %	France
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	Obligations d'État	0,44 %	Allemagne
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,43 %	France
ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D')	Obligations d'État	0,43 %	Allemagne
ROYAUME-UNI DE GRANDE-BRETAGNE ET RegS	Obligations d'État	0,42 %	Royaume-Uni
ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D')	Obligations d'État	0,41 %	Allemagne
ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D')	Obligations d'État	0,41 %	Allemagne
ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D') RegS	Obligations d'État	0,41 %	Allemagne
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,41 %	France



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 99,86 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

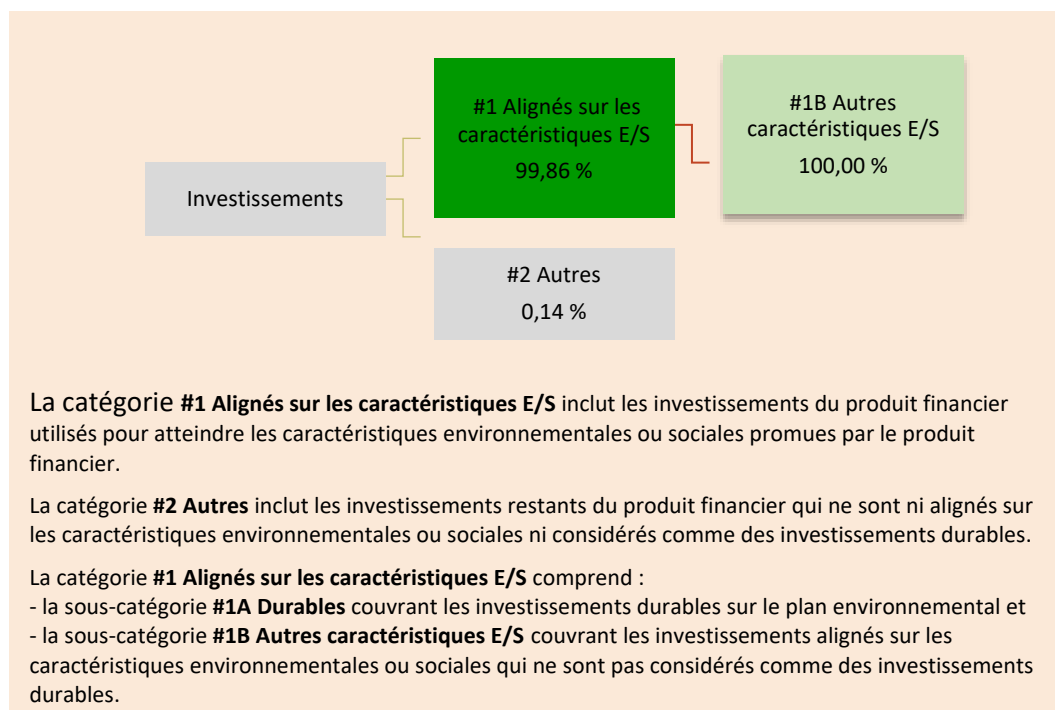
Jusqu'à 0,14 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

- des **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par type de titre au 31 décembre 2023.

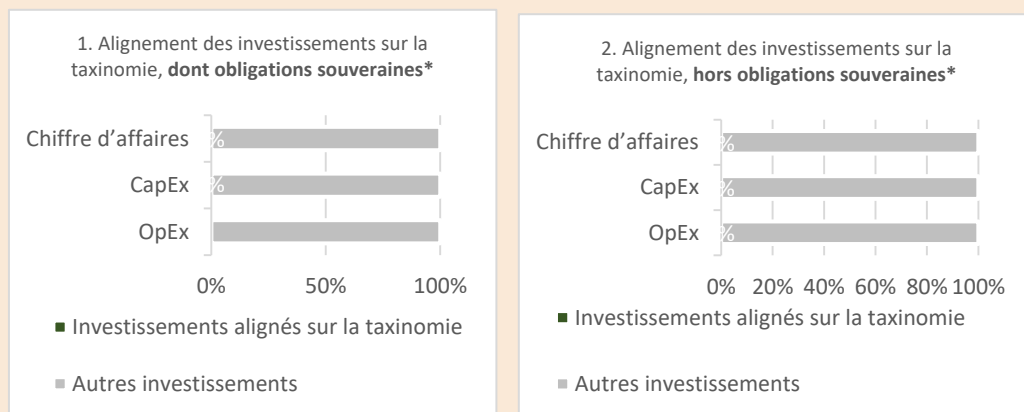
Type de titre	Actifs du produit financier
Obligations d'État	99,86 %
Autres / non classés	0,14 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'effectuait pas d'allocation à des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'effectuait pas d'allocation à des activités économiques durables contribuant à un objectif social.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts assortis ou non de sûretés (liquidités) et des actions d'autres organismes de placement collectif qui suivaient une stratégie de marché monétaire au 31 décembre 2023.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en excluant ou en repondérant des émetteurs de l'Indice parent en appliquant certains critères ESG dérivés de la série d'indices FTSE ESG Government Bond Index à chaque rééquilibrage de l'Indice de référence. Les pondérations des composants étaient ajustées dans l'Indice de référence par rapport à l'Indice parent en surpondérant les pays présentant des résultats ESG plus élevés et en sous-pondérant les pays ayant des résultats ESG inférieurs avant d'appliquer certains autres critères d'inclusion aux composants de l'Indice parent. La pondération de la valeur de marché de chaque titre était « inclinée » par le score ESG de son pays respectif, de sorte que la pondération de chaque émetteur dans l'Indice de référence soit fonction de la pondération de la valeur de marché et du score ESG du pays comme indiqué ci-dessus. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs bénéficiaires des investissements, destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement définissant les types et les méthodes d'engagement, les stratégies de remontée et les attentes concernant la communication avec, entre autres, DWS en tant qu'investisseur et

DWS pour le compte de ses clients sur un certain nombre de sujets, y compris les critères ESG.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice FTSE ESG Select World Government Bond Index – DM comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice de référence est basé sur l'Indice parent, qui est conçu pour refléter la performance d'obligations souveraines à taux fixe, libellées en devise locale et de qualité « investment grade » émises sur des marchés développés.

L'Indice de référence détermine ses composants en appliquant certains critères ESG dérivés de la série d'indices FTSE ESG Government Bond Index. Les pondérations des composants sont ajustées dans l'Indice de référence par rapport à l'Indice parent en surpondérant les pays présentant des résultats ESG plus élevés et en sous-pondérant les pays ayant des résultats ESG inférieurs avant d'appliquer certains autres critères d'inclusion aux composants de l'Indice parent. La pondération de la valeur de marché de chaque titre est « inclinée » par le score ESG de son pays respectif, de sorte que la pondération de chaque émetteur dans l'Indice de référence soit fonction de la pondération de la valeur de marché et du score ESG du pays.

Scores ESG

Les scores ESG des pays sont calculés en fonction des pays figurant dans l'Indice parent. Ces scores ESG sont destinés à évaluer l'exposition d'un pays à certains facteurs de risque ESG et la gestion de ces derniers, déterminés par le profil de durabilité du contrôleur de risque souverain Beyond Ratings. Beyond Ratings est un fournisseur de données intelligentes et d'analyses pour l'intégration (ESG) dans les obligations à revenu fixe. De plus amples informations sont disponibles à l'adresse :

https://content.ftserussell.com/sites/default/files/sovereign_risk_monitor_methology_final_0.pdf

Les scores ESG de chaque pays sont établis en évaluant et en notant la performance de chaque pays selon les trois piliers suivants :

- la performance environnementale : s'appuie sur des sujets tels que l'énergie, le climat et les ressources ;
- la performance sociale : s'appuie sur des sujets tels que l'inégalité, l'emploi, le capital humain, la santé et le bien-être de la société ; et
- la performance de gouvernance : s'appuie sur des sujets tels que la corruption, l'efficacité du gouvernement, la stabilité politique, la qualité de la réglementation, l'état de droit, la voix et la responsabilité.

Ces scores de piliers sont ensuite comparés, sur une base relative, à ceux d'autres pays de l'univers de l'Indice de référence avec un « facteur d'inclinaison » spécifique appliqué à chaque score de pilier. Les scores des piliers obtenus sont

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

ensuite combinés pour obtenir un seul et unique score ESG combiné pour chaque pays.

Les scores ESG des pays sont ensuite appliqués pour recalculer la pondération de la valeur de marché de chaque pays dans l'Indice de référence par rapport à l'Indice parent afin de fournir une exposition plus élevée aux pays qui ont un score ESG plus élevé et une exposition plus faible aux pays qui ont un score ESG plus faible.

Pour plus d'informations sur les piliers ESG, les indicateurs ESG sous-jacents et la méthodologie d'« inclinaison » ESG, reportez-vous aux règles de base de la série d'indices FTSE ESG Government Bond Index.

[https://research.ftserussell.com/products/downloads/FTSE ESG Government Bond Index Series Ground Rules.pdf](https://research.ftserussell.com/products/downloads/FTSE_ESG_Government_Bond_Index_Series_Ground_Rules.pdf)

Critères d'inclusion des pays

Une autre évaluation des critères d'inclusion des pays est ensuite effectuée en classant les pays en fonction de leur score ESG. Les pays identifiés comme retardataires significatifs (c'est-à-dire classés dans un certain centile le plus bas) sont retirés de l'Indice de référence. Pour plus d'informations sur les seuils d'exclusion, reportez-vous aux règles de base de l'indice FTSE ESG Select World Government Bond Index – DM.

https://www.lseg.com/content/dam/ftse-russell/en_us/documents/ground-rules/ftse-esg-select-government-bond-index-series-ground-rules.pdf

Critères de liberté

L'Indice de référence applique également des critères d'inclusion supplémentaires basés sur les données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. Seuls les pays classés « libres » peuvent être inclus dans l'Indice de référence. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>. Pour plus de détails, reportez-vous aux règles de base de l'indice FTSE ESG Select World Government Bond Index – DM.

https://www.lseg.com/content/dam/ftse-russell/en_us/documents/ground-rules/ftse-esg-select-government-bond-index-series-ground-rules.pdf

Les investisseurs sont informés que, bien que le produit financier et l'Indice de référence cherchent à garantir le respect de ces critères à chaque date de rééquilibrage ou de révision, entre ces révisions ou rééquilibrages, les titres qui ne répondent plus à ces critères peuvent rester inclus dans (i) l'Indice de référence jusqu'à ce qu'ils soient retirés lors du rééquilibrage suivant ou de la révision suivante ou, (ii) le portefeuille du produit financier jusqu'à ce qu'il soit possible de céder ces positions.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Score Freedom House	90,34	90,34
Score de pilier environnemental d'un pays	4,88	4,88
Score de pilier social d'un pays	7,52	7,52
Score de pilier de gouvernance d'un pays	6,95	6,95

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	2,94 %	3,15 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	2,94 %	0,00 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II ESG Eurozone Government Bond UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 2549000GO3T2K1FRUV52

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de ___ % d'investissements durables (au 31/12/2023)

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Ce produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice FTSE ESG Select EMU Government Bond Index (l'« Indice de

référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier détenait un portefeuille de titres comprenant des composants de l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de référence était conçu pour représenter la performance des obligations souveraines à taux fixe, de qualité « investment grade », libellées en euro et émises sur des pays de marchés développés au sein de l'Union économique et monétaire, (« UEM »), à l'exclusion des pays qui ne remplissaient pas des critères ESG (environnementaux, sociaux et de gouvernance) spécifiques.

L'Indice de référence comprenait des titres émis par des pays de l'UEM dans l'indice FTSE ESG Select World Government Bond Index – DM (l'« Indice parent »). L'Indice parent était conçu pour mesurer la performance des obligations souveraines de qualité « investment grade » à taux fixe, libellées en devise locale, émises dans des pays des marchés développés et incluses dans l'indice FTSE World Government Bond Index – DM (l'« Indice parent ultime »), à l'exclusion des pays ne remplissant pas des critères ESG spécifiques. Les pays exclus de l'Indice parent étaient également exclus de l'Indice de référence. L'Indice parent excluait les pays sur la base des critères suivants :

Critères d'inclusion des pays

L'Indice parent appliquait une évaluation des critères d'inclusion des pays en classant les pays en fonction de leurs scores ESG. Les pays identifiés comme des retardataires significatifs étaient retirés de l'Indice parent. Pour plus d'informations sur les seuils d'exclusion, consultez le site : <https://www.ftserussell.com/products/indices/custom-methodologies>.

Critères de liberté

L'Indice parent appliquait également des critères d'inclusion basés sur les données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Seuls les pays classés « libres » pouvaient être inclus dans l'Indice parent. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Critères ESG et inclinaison

Les pondérations des composants éligibles étaient ajustées dans l'Indice de référence par rapport au sous-ensemble UEM de l'Indice parent ultime en surpondérant les pays présentant des résultats ESG plus élevés et en sous-pondérant les pays ayant des résultats ESG inférieurs. La pondération de la valeur de marché de chaque titre était « inclinée » par le score ESG de son pays respectif, de sorte que la pondération de chaque émetteur dans l'Indice de référence soit fonction de la pondération de la valeur de marché et du score ESG du pays (la « Pondération inclinée »).

Les scores ESG des pays étaient destinés à évaluer l'exposition d'un pays à certains facteurs de risque ESG et la gestion de ces derniers, déterminés par le profil de durabilité du contrôleur de risque souverain Beyond Ratings. Beyond Ratings est un fournisseur de données intelligentes et d'analyses pour l'intégration ESG dans les obligations à revenu fixe.

Les scores ESG de chaque pays étaient établis en évaluant et en notant la performance de chaque pays selon les trois piliers suivants :

- la performance environnementale : s'appuyait sur des sujets tels que l'énergie, le climat et les ressources ;
- la performance sociale : s'appuyait sur des sujets tels que l'inégalité, l'emploi, le capital humain, la santé et le bien-être de la société ; et
- la performance de gouvernance : s'appuyait sur des sujets tels que la corruption, l'efficacité du gouvernement, la stabilité politique, la qualité de la réglementation, l'état de droit, la voix et la responsabilité.

Les scores relatifs à ces piliers étaient ensuite comparés sur une base relative par rapport aux autres composants éligibles de l'Indice de référence avec un « facteur d'inclinaison » spécifique appliqué au score de chaque pilier, puis combinés pour obtenir un seul score ESG combiné pour chaque pays. Ce score ESG unique était ensuite utilisé pour déterminer la Pondération inclinée de chaque émetteur dans l'Indice de référence.

De plus amples informations sur les Piliers ESG, les Indicateurs sous-jacents et la méthodologie d'Inclinaison ESG sont disponibles à l'adresse suivante :

https://research.ftserussell.com/products/downloads/FTSE_ESG_Select_Government_Bond_Index_Series_Ground_Rules.pdf

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Score Freedom House	moyenne pondérée du score de la valeur de marché du portefeuille du produit financier calculée selon le processus de classification et de notation « Liberté dans le monde » de Freedom House.	92,81
Score de pilier environnemental d'un pays	Moyenne pondérée du score de risque environnemental souverain de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques environnementaux tels que mesurés par MSCI.	4,32
Score de pilier social d'un pays	moyenne pondérée du score de risque social souverain de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques sociaux tels que mesurés par MSCI.	7,88

Score de pilier de gouvernance d'un pays	Moyenne pondérée du score de risque de gouvernance souveraine de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques de gouvernance, tels que mesurés par MSCI.	7,79
--	--	------

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Indicateur (tel que décrit ci-dessus)	Performance (au 31/12/2022)	Performance (au 31/12/2023)
Score Freedom House	92,74	92,81
Score de pilier environnemental d'un pays	4,49	4,32
Score de pilier social d'un pays	8,26	7,88
Score de pilier de gouvernance d'un pays	7,66	7,79

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

S/O. Le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a donc pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne causent pas de préjudice important à l'un de ces objectifs et que les émetteurs suivent des pratiques de bonne gouvernance.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

- — *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et qu'il investissait uniquement dans de la dette souveraine, aucun indicateur d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité n'avait été pris en compte afin de déterminer quelles activités économiques durables contribuaient à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

- — *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?*

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

L'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (n° 16).

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 01/01/2023 au 31/12/2023

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier à la fin de chaque trimestre.

Investissements les plus importants	Type de titre	% d'actifs	Pays
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	1,27 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	1,16 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	1,16 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	1,15 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	1,11 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	1,05 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	1,01 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,99 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,98 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,98 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,97 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,97 %	France
PAYS-BAS (ROYAUME DES)	Obligations d'État	0,94 %	Pays-Bas
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,93 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,93 %	France



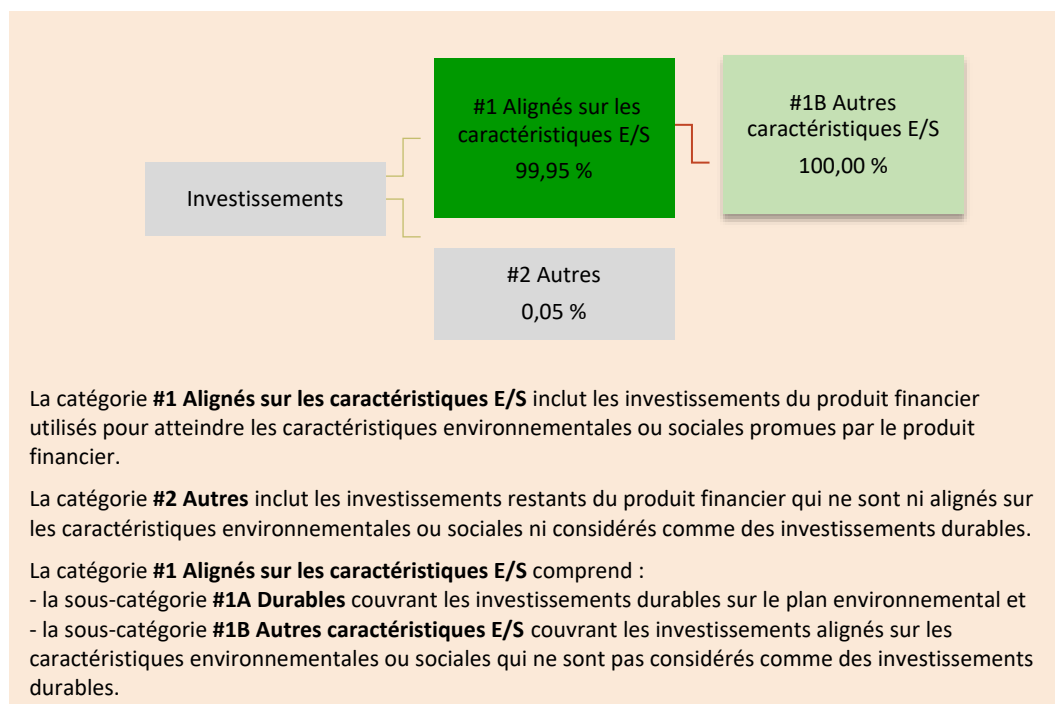
L'**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● *Quelle était l'allocation des actifs ?*

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 99,95 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

0,05 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par type de titre au 31 décembre 2023.

Type de titre	Actifs du produit financier
Obligations d'État	99,95 %
Autres / non classés	0,05 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

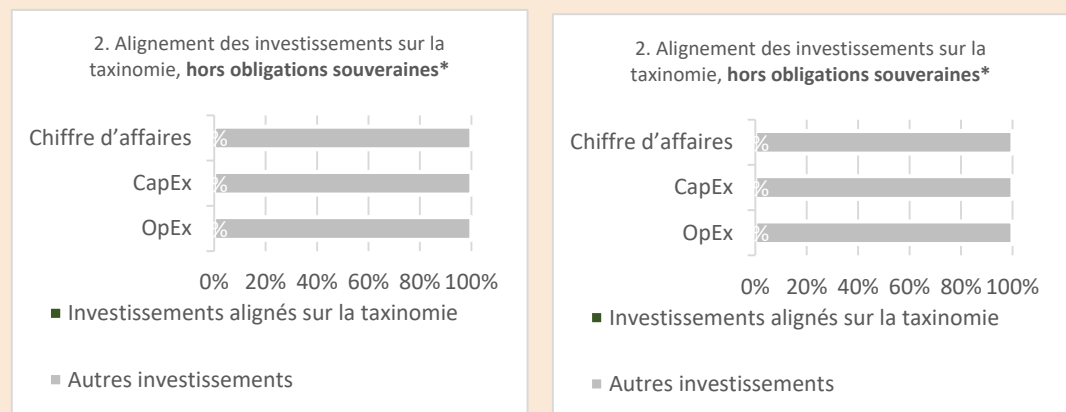
S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'effectuait pas d'allocation à des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'effectuait pas d'allocation à des activités économiques durables contribuant à un objectif social.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts assortis ou non de sûretés (liquidités) et des actions d'autres organismes de placement collectif qui suivaient une stratégie de marché monétaire au 31 décembre 2023.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en excluant ou en repondérant des émetteurs du sous-ensemble de l'UEM de l'Indice parent ultime en appliquant certains critères ESG dérivés de la série d'indices FTSE ESG Government Bond Index à chaque rééquilibrage de l'Indice de référence. L'Indice parent appliquait certains critères d'inclusion aux composants de l'Indice parent ultime. Les pays exclus de l'Indice parent étaient également exclus de l'Indice de référence. Les pondérations des composants étaient ajustées dans l'Indice de référence par rapport au sous-ensemble UEM de l'Indice parent ultime en surpondérant les pays présentant des résultats ESG plus élevés et en sous-pondérant les pays ayant des résultats ESG inférieurs. La pondération de la valeur de marché de chaque titre était « inclinée » par le score ESG de son pays respectif, de sorte que la pondération de chaque émetteur dans l'Indice de référence soit fonction de la pondération de la valeur de marché et du score ESG du pays comme indiqué ci-dessus. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs bénéficiaires des investissements, destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement définissant les types et les méthodes d'engagement, les stratégies de remontée et les attentes concernant la communication avec, entre autres, DWS en tant qu'investisseur et DWS pour le compte de ses clients sur un certain nombre de sujets, y compris les critères ESG.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice FTSE ESG Select EMU Government Bond Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice de référence est basé sur l'Indice parent, qui est conçu pour refléter la performance d'obligations souveraines de qualité « investment grade » à taux fixe, libellées en devise locale, émises dans des pays des marchés développés et incluses dans l'Indice parent ultime, à l'exclusion des pays ne remplissant pas des critères ESG spécifiques. Les pays exclus de l'Indice parent seront également exclus de l'Indice de référence. L'Indice parent exclut les pays sur la base des critères suivants :

Critères d'inclusion des pays

L'Indice parent applique une évaluation des critères d'inclusion des pays en classant les pays en fonction de leurs scores ESG. Les pays identifiés comme des retardataires significatifs sont retirés de l'Indice parent. Pour plus d'informations sur les seuils d'exclusion, consultez le site : <https://www.ftserussell.com/products/indices/custom-methodologies>.

Critères de liberté

L'Indice parent applique également des critères d'inclusion basés sur les données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Seuls les pays classés « libres » peuvent être inclus dans l'Indice parent. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Critères ESG et inclinaison

Les pondérations des composants éligibles sont ajustées dans l'Indice de référence par rapport au sous-ensemble UEM de l'Indice parent ultime en surpondérant les pays présentant des résultats ESG plus élevés et en sous-pondérant les pays ayant



Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

des résultats ESG inférieurs. La pondération de la valeur de marché de chaque titre est « inclinée » par le score ESG de son pays respectif, de sorte que la pondération de chaque émetteur dans l'Indice de référence soit fonction de la pondération de la valeur de marché et du score ESG du pays (la « Pondération inclinée »).

Les scores ESG des pays sont destinés à évaluer l'exposition d'un pays à certains facteurs de risque ESG et la gestion de ces derniers, déterminés par le profil de durabilité du contrôleur de risque souverain Beyond Ratings. Beyond Ratings est un fournisseur de données intelligentes et d'analyses pour l'intégration ESG dans les obligations à revenu fixe.

Les scores ESG de chaque pays sont établis en évaluant et en notant la performance de chaque pays selon les trois piliers suivants :

- la performance environnementale : s'appuie sur des sujets tels que l'énergie, le climat et les ressources ;
- la performance sociale : s'appuie sur des sujets tels que l'inégalité, l'emploi, le capital humain, la santé et le bien-être de la société ; et
- la performance de gouvernance : s'appuie sur des sujets tels que la corruption, l'efficacité du gouvernement, la stabilité politique, la qualité de la réglementation, l'état de droit, la voix et la responsabilité.

Les scores relatifs à ces piliers sont ensuite comparés sur une base relative par rapport aux autres composants éligibles de l'Indice de référence avec un « facteur d'inclinaison » spécifique appliqué au score de chaque pilier, puis combinés pour obtenir un seul score ESG combiné pour chaque pays. Ce score ESG unique est ensuite utilisé pour déterminer la Pondération inclinée de chaque émetteur dans l'Indice de référence.

De plus amples informations sur les Piliers ESG, les Indicateurs sous-jacents et la méthodologie d'Inclinaison ESG sont disponibles à l'adresse suivante :

https://research.ftserussell.com/products/downloads/FTSE_ESG_Select_Government_Bond_Index_Series_Ground_Rules.pdf

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Score Freedom House	92,81	92,81
Score de pilier environnemental d'un pays	4,32	4,32
Score de pilier social d'un pays	7,88	7,88
Score de pilier de gouvernance d'un pays	7,79	7,79

- *Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?*

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	6,17 %	6,32 %

- *Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?*

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	6,17 %	0,00 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II Eurozone Government Green Bond UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique : 25490001WFLHO43NY710

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Oui	<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Non
<input checked="" type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : 99,97 % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et , bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input checked="" type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : 0,00 %	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le produit financier avait pour objectif l'investissement durable et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 9(1) du SFDR en répliquant l'indice iBoxx EUR Eurozone Sovereigns Green Bonds Capped Index (l'« Indice de référence »). L'Indice

de référence était conçu pour refléter la performance des obligations vertes souveraines libellées en EUR. Les règles de l'Indice de référence visaient à offrir une vaste couverture de l'univers des obligations vertes souveraines, répondant à certains critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG ») minimum. Le produit financier détenait un portefeuille de titres incluant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles.

L'Indice de référence déterminait ses composants en appliquant les critères de sélection ESG suivants :

- (1) **Freedom House Global Freedom Status** : L'Indice de référence appliquait un critère d'inclusion basé sur les données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. Seules les obligations souveraines émises par des pays classés « libres » ou « partiellement libres » pouvaient être incluses dans l'Indice de référence. De plus amples informations sur la méthodologie sont disponibles sous l'en-tête « Reports » à l'adresse <https://freedomhouse.org>.
- (2) **Catégorie Risque-Pays Sustainalytics** : les Notations de Risque-Pays étaient utilisées pour déterminer la Catégorie Risque-Pays Sustainalytics. Les Notations de Risque-Pays calculaient le degré de risque ESG non géré d'un pays. Le risque non géré est mesuré sur une échelle ouverte allant de zéro (sans risque) à un score maximum inférieur à 50, pour 95 % des cas. Les émetteurs étaient ensuite regroupés dans l'une des cinq catégories de risque suivantes : négligeable (0-10), faible (10-20), moyen (20-30), élevé (30-40) et grave (40+). Tous les émetteurs dont la Catégorie de Risque-Pays Sustainalytics était « grave » étaient exclus de l'Indice de référence. En cas de changement de catégorie, le pays était ajouté ou supprimé lors du rééquilibrage mensuel. De plus amples informations sur les Catégories de Risque-Pays sont disponibles sur le site Internet de Sustainalytics (<https://www.sustainalytics.com/>), dans la rubrique « ESG Risk Ratings » (notations de risque ESG).
- (3) **Classification des Obligations Vertes** : L'Indice de référence utilisait des sources de données externes indépendantes pour déterminer la classification des obligations « vertes ». Seules étaient éligibles les obligations classées par la Climate Bond Initiative (« CBI ») comme « obligations vertes » conformément à la taxinomie des obligations climatiques de la CBI. Ces critères allaient au-delà des conventions d'auto-labellisation et évaluaient la crédibilité d'un actif et son impact sur l'environnement. La taxinomie des obligations climatiques de la CBI déterminait si l'utilisation des produits générés par chaque obligation verte contribuerait à l'effort plus vaste de transition vers une économie à faible émission de carbone. La CBI vérifiait que les émissions de gaz à effet de serre générées soient conformes à l'objectif premier des 2 degrés de réchauffement climatique fixé par l'accord de Paris sur le climat. La taxinomie de la CBI a été développée à partir des derniers acquis scientifiques en matière de climat, y compris des recherches du groupe d'experts

intergouvernemental sur l'évolution du climat, l'Agence internationale de l'énergie, et a bénéficié de l'aide de centaines d'experts techniques du monde entier.

L'Indice de référence appliquait un critère d'inclusion basé sur les données de Sustainalytics, qui appartient à Morningstar. Sustainalytics est une société indépendante de recherche, de notation et d'analyse ESG et de gouvernance d'entreprise de premier plan qui aide les investisseurs du monde entier à développer et mettre en œuvre des stratégies d'investissement responsables. L'Indice de référence utilisait tout particulièrement les produits ESG suivants : Sustainalytics ESG Risk Rating Scores, Controversies, Country Ratings, Global Standards Screening, Product Involvement et Controversial Weapons Involvement. Pour plus de détails sur l'ensemble de la gamme des produits ESG de Sustainalytics ESG Research, veuillez consulter : <http://www.sustainalytics.com>.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.	Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
	Exposition aux obligations vertes	<p>Le pourcentage du portefeuille du produit financier qui est exposé à des titres identifiés comme « obligations vertes », tel que déterminé par Refinitiv, en intégrant les données et les classifications de la Climate Bond Initiative. Afin d'être identifié comme une obligation verte, l'actif et l'émetteur doivent répondre aux exigences suivantes :</p> <p>(i) Obligation verte certifiée par la CBI : Ces obligations sont émises selon les principes des obligations vertes propres à l'émetteur ou selon les principes des obligations vertes de la CBI et sont également certifiées vertes par la CBI.</p> <p>(ii) Obligation verte autolabellisée : Ces obligations sont labellisées vertes par les émetteurs, mais ne répondent pas aux critères de la CBI.</p> <p>(iii) Obligation verte vérifiée par la CBI : Ces obligations sont des titres labellisés qui répondent également aux principes des obligations vertes de la CBI. Ces émetteurs émettent des obligations vertes selon les principes des obligations vertes qui leur sont propres.</p>	99,97 %
	Score ESG du gouvernement	La moyenne pondérée des notes ESG des gouvernements de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, qui indique la performance environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) globale d'un pays/d'une région, telle que déterminée par MSCI.	6,64

● *...et par rapport aux périodes précédentes ?*

Indicateur (tel que décrit ci-dessus)	Performance (au 31/12/2022)	Performance (au 31/12/2023)
Exposition aux obligations vertes	99,99 %	99,97 %
Score ESG du gouvernement	6,71	6,64

● *Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?*

Conformément à l'article 2(17) du SFDR, ces investissements durables ne devaient pas causer de préjudice important à des objectifs environnementaux ou sociaux, et ces émetteurs d'investissement durable devaient suivre des pratiques de bonne gouvernance. Tout investissement qui ne respectait pas les seuils liés au principe consistant à ne pas causer de préjudice important n'était pas pris en compte dans la part d'investissement durable du produit financier. Ces seuils incluaient notamment :

- L'implication dans des violations de normes sociales ; et
- la violation de certains seuils d'indicateurs de principales incidences négatives.

— *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (n° 16).

— *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

S/O. – Le produit financier investissait uniquement dans de la dette souveraine.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (n° 16).

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente les quinze principaux investissements du produit financier à la fin de chaque trimestre.

Investissements les plus importants	Type de titre	% d'actifs	Pays
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	17,76 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	7,75 %	France
PAYS-BAS (ROYAUME DES)	Obligations d'État	7,26 %	Pays-Bas
ITALIE (RÉPUBLIQUE D')	Obligations d'État	7,01 %	Italie
BELGIQUE (ROYAUME DE) RegS	Obligations d'État	6,16 %	Belgique
ITALIE (RÉPUBLIQUE D')	Obligations d'État	5,38 %	Italie
ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D') RegS	Obligations d'État	5,34 %	Allemagne
ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D') RegS	Obligations d'État	4,95 %	Allemagne
ITALIE (RÉPUBLIQUE D')	Obligations d'État	4,74 %	Italie
ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D') RegS	Obligations d'État	4,60 %	Allemagne
ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D') RegS	Obligations d'État	4,46 %	Allemagne
IRLANDE (RÉPUBLIQUE D') RegS	Obligations d'État	4,12 %	Irlande
ESPAGNE (ROYAUME D') RegS	Obligations d'État	4,02 %	Espagne

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 01/01/2023 au 31/12/2023

ALLEMAGNE (RÉPUBLIQUE FÉDÉRALE D') RegS	Obligations d'État	3,46 %	Allemagne
BELGIQUE ROYAUME DE (GOUVERNEMENT)	Obligations d'État	3,33 %	Belgique

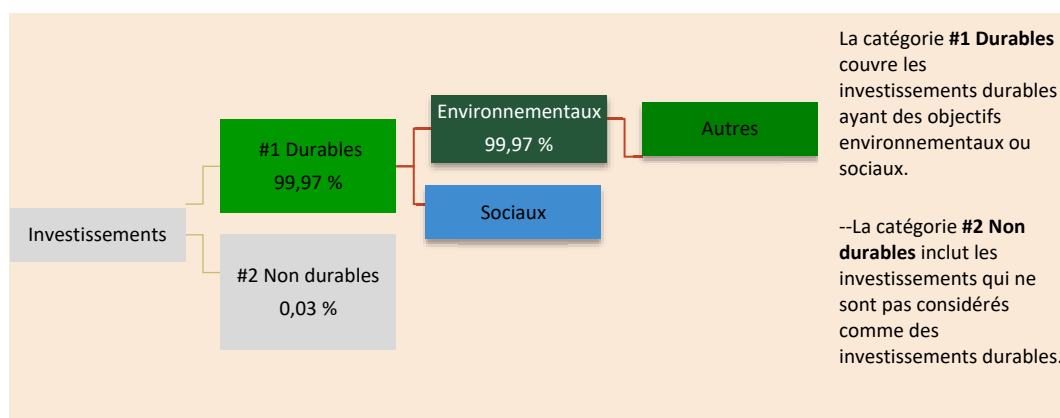


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 99,97 % de son actif net dans des investissements alignés sur des investissements durables avec un objectif environnemental.

0,03 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Non durables).



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par type de titre au 31 décembre 2023.

Type de titre	Actifs du produit financier
Obligations d'État	99,97 %
Autres / non classés	0,03 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

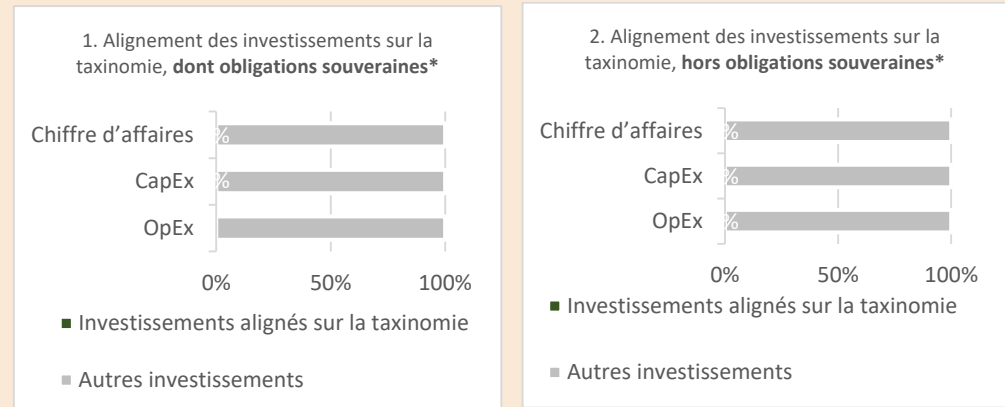
S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
 - Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au gaz fossile comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'énergie nucléaire, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités économiques pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2023, la part des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental non alignées sur la taxinomie de l'UE était de 99,97 %.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif social. Au 31 décembre 2023, la part des activités économiques durables contribuant à un objectif social était de 0,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier cherchait principalement à promouvoir l'allocation des actifs dans des investissements qui étaient des investissements durables ayant un objectif environnemental (#1 Durables).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts (liquidités) assortis ou non de sûretés au 31 décembre 2023.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence tenait compte des facteurs de durabilité conformément à l'objectif d'investissement durable en visant à proposer une vaste couverture de l'univers des obligations souveraines vertes, répondant à certains critères ESG minimaux. L'Indice de référence incluait uniquement les obligations classées par la Climate Bond Initiative (« CBI ») comme « obligations vertes » conformément à la taxinomie des obligations climatiques de la CBI. En ce qui concerne les critères ESG, la Catégorie de Risque-Pays Sustainalytics et le Freedom House Global Freedom Status étaient utilisés pour exclure certains pays. Tous les émetteurs dont la Catégorie de Risque-Pays Sustainalytics était « grave » étaient exclus de l'Indice de référence, et seuls les pays désignés comme « libres » ou « partiellement libres » pouvaient être inclus dans l'Indice de référence, entre autres. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

L'engagement actif auprès des émetteurs bénéficiaires des investissements, destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement définissant les types et les méthodes d'engagement, les stratégies de remontée et les attentes concernant la communication avec, entre autres, DWS en tant qu'investisseur et DWS pour le compte de ses clients sur un certain nombre de sujets, y compris les critères ESG.



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Le produit financier a désigné l'indice iBoxx EUR Eurozone Sovereigns Green Bonds Capped Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● **En quoi l'indice de référence différait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice de référence se distinguait d'un indice de marché large pertinent en incluant uniquement les obligations classées par la Climate Bond Initiative (« CBI ») comme « obligations vertes » conformément à la taxinomie des obligations climatiques de la CBI, et répondant à certains critères ESG minimaux.

Climate Bond Initiative (« CBI »)

L'Indice de référence utilisait des sources de données externes indépendantes pour déterminer la classification des obligations « vertes ». Seules étaient éligibles les obligations classées par la Climate Bond Initiative (« CBI ») comme « obligations vertes » conformément à la taxinomie des obligations climatiques de la CBI. Ces critères allaient au-delà des conventions d'auto-labellisation et évaluaient la crédibilité d'un actif et son impact sur l'environnement. La taxinomie des obligations climatiques de la CBI déterminait si l'utilisation des produits générés par chaque obligation verte contribuerait à l'effort plus vaste de transition vers une économie à faible émission de carbone. La CBI vérifiait que les émissions de gaz à effet de serre générées soient conformes à l'objectif premier des 2 degrés de réchauffement climatique fixé par l'accord de Paris sur le climat. La taxinomie de la CBI a été développée à partir des derniers acquis scientifiques en matière de climat, y compris des recherches du groupe d'experts intergouvernemental sur l'évolution du climat, l'Agence internationale de l'énergie, et a bénéficié de l'aide de centaines d'experts techniques du monde entier.

Catégorie de Risque-Pays Sustainalytics

les Notations de Risque-Pays étaient utilisées pour déterminer la Catégorie Risque-Pays Sustainalytics. Les Notations de Risque-Pays calculaient le degré de risque ESG non géré d'un pays. Le risque non géré est mesuré sur une échelle ouverte allant de zéro (sans risque) à un score maximum inférieur à 50, pour 95 % des cas. Les émetteurs étaient ensuite regroupés dans l'une des cinq catégories de risque suivantes : négligeable (0-10), faible (10-20), moyen (20-30), élevé (30-40) et grave (40+). Tous les émetteurs dont la Catégorie de Risque-Pays Sustainalytics était « grave » étaient exclus de l'Indice de référence. En cas de changement de

catégorie, le pays était ajouté ou supprimé lors du rééquilibrage mensuel. De plus amples informations sur les Catégories de Risque-Pays sont disponibles sur le site Internet de Sustainalytics (<https://www.sustainalytics.com/>), dans la rubrique « ESG Risk Ratings » (notations de risque ESG).

Freedom House Global Freedom Status

L'Indice de référence appliquait un critère d'inclusion basé sur les données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. Seules les obligations souveraines émises par des pays classés « libres » ou « partiellement libres » pouvaient être incluses dans l'Indice de référence. De plus amples informations sur la méthodologie sont disponibles sous l'en-tête « Reports » à l'adresse <https://freedomhouse.org>.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Exposition aux obligations vertes	99,97 %	100,00 %
Score ESG du gouvernement	6,64	6,64

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	9,38 %	9,53 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	9,38 %	7,15 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II Eurozone Government Bond ESG Tilted UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 254900P8XOXFDVXLAS51

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de ___ % d'investissements durables (au 31/12/2023)

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice iBoxx EUR Sovereigns ESG Tilted Index (l'« Indice de référence »), qui

incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier détenait un portefeuille de titres comprenant des composants de l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de référence était conçu pour représenter la performance d'obligations souveraines libellées en euro avec des pondérations ajustées qui répondaient à certaines normes environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) minimales, en allouant des pondérations supérieures aux pays ayant une notation Risque-Pays favorable et en réduisant les pondérations des pays ayant une notation Risque-Pays moins favorable.

L'Indice de référence déterminait ses composants en appliquant les critères de sélection ESG suivants :

- (1) **Freedom House Global Freedom Status** : L'Indice de référence appliquait des critères d'inclusion supplémentaires basés sur les données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. Dans le calcul de l'Indice de référence, seuls les pays classés « libres » ou « partiellement libres » pouvaient être inclus. De plus amples informations sur la méthodologie sont disponibles sous l'en-tête « Reports » à l'adresse <https://freedomhouse.org>.
- (2) **Notation Risque-Pays Sustainalytics** : une fois l'univers obligataire éligible défini, les pays de cet univers étaient pondérés en fonction de leurs « Notations Risque-Pays Sustainalytics » relatives. La notation du risque pour un pays mesurait l'ampleur du risque ESG non géré. Une notation faible indiquait un niveau inférieur de risque ESG non géré et une notation élevée indiquait un niveau supérieur de risque ESG non géré. Les pays étaient ensuite regroupés dans l'une des cinq Catégories Risque-Pays (négligeable, faible, moyen, élevé, grave), comme décrit ci-dessous et selon la Notation Risque-Pays calculée. Les pondérations des émetteurs étaient ensuite orientées de préférence vers les pays présentant des niveaux de risque ESG non gérés plus faibles (soit une Notation Risque-Pays plus faible) grâce à l'application d'un nouveau facteur de pondération et de la pondération préorientée de l'émetteur. Ce nouveau facteur de pondération évaluait la variation de la Notation Risque-Pays de chaque émetteur par rapport à la moyenne de l'univers éligible. Le pays ayant la Notation Risque-Pays la plus basse par rapport à la moyenne se voyait attribuer un nouveau facteur de pondération de 0,5 et le pays avec la Notation Risque-Pays la plus élevée par rapport à la moyenne obtenait un nouveau facteur de pondération de 2. Un nouveau facteur de pondération était attribué aux pays compris dans cette fourchette par l'application d'une formule non linéaire relative à la variation de cet émetteur par rapport à la moyenne de la Notation Risque-Pays. Les pondérations des pays étaient ensuite normalisées pour que leur somme représente 100 %. Vous trouverez de plus amples informations sur les Notations Risque-Pays sur le site Internet de Sustainalytics (<https://www.sustainalytics.com/>) à la section ESG Risk Ratings (notations de risque ESG).

- (3) **Catégorie Risque-Pays Sustainalytics** : Les Notations Risque-Pays décrites ci-dessus calculaient le degré de risque ESG non géré qu'un pays pouvait avoir. Le risque non géré est mesuré sur une échelle ouverte allant de zéro (sans risque) à un score maximum inférieur à 50, pour 95 % des cas. Les émetteurs étaient ensuite regroupés dans l'une des cinq catégories de risque suivantes : négligeable (0-10), faible (10-20), moyen (20-30), élevé (30-40) et grave (40+). Tous les émetteurs dont la Catégorie de Risque-Pays Sustainalytics était « grave » étaient exclus de l'Indice de référence. En cas de changement de catégorie, le pays pouvait être ajouté ou supprimé lors du rééquilibrage mensuel. De plus amples informations sur les Catégories de Risque-Pays sont disponibles sur le site Internet de Sustainalytics (<https://www.sustainalytics.com/>), dans la rubrique « ESG Risk Ratings » (notations de risque ESG).

L'Indice de référence appliquait des critères d'inclusion basés sur les données de Sustainalytics, qui appartient à Morningstar. Sustainalytics est une société indépendante de recherche, de notation et d'analyse ESG et de gouvernance d'entreprise de premier plan qui aide les investisseurs du monde entier à développer et mettre en œuvre des stratégies d'investissement responsables. L'Indice de référence utilisait tout particulièrement les produits ESG suivants : Sustainalytics ESG Risk Rating Scores, Controversies, Country Ratings, Global Standards Screening, Product Involvement et Controversial Weapons Involvement. Pour de plus amples informations sur l'ensemble des recherches ESG de Sustainalytics des produits ESG, veuillez consulter le site : <http://www.sustainalytics.com>.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Score Freedom House	moyenne pondérée du score de la valeur de marché du portefeuille du produit financier calculée selon le processus de classification et de notation « Liberté dans le monde » de Freedom House.	92,13
Score de pilier environnemental d'un pays	moyenne pondérée du score de risque environnemental souverain de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques environnementaux tels que mesurés par MSCI.	4,19
Score de pilier social d'un pays	moyenne pondérée du score de risque social souverain de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques sociaux tels que mesurés par MSCI.	7,53

Score de pilier de gouvernance d'un pays	moyenne pondérée du score de risque de gouvernance souveraine de la valeur de marché du portefeuille du produit financier, évaluant la performance globale des émetteurs en termes de facteurs de risques de gouvernance, tels que mesurés par MSCI.	7,31
--	--	------

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Indicateur (tel que décrit ci-dessus)	Performance (au 31/12/2022)	Performance (au 31/12/2023)
Score Freedom House	91,99	92,13
Score de pilier environnemental d'un pays	4,34	4,19
Score de pilier social d'un pays	7,86	7,53
Score de pilier de gouvernance d'un pays	7,17	7,31

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

S/O. Le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a donc pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne causent pas de préjudice important à l'un de ces objectifs et que les émetteurs suivent des pratiques de bonne gouvernance.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

— **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et qu'il investissait uniquement dans de la dette souveraine, aucun indicateur d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité n'avait été pris en compte afin de déterminer quelles activités économiques durables contribuaient à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

— — *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?*

S/O. Étant donné que le produit financier n'entendait pas réaliser d'investissements durables et investissait uniquement dans de la dette souveraine, il n'a pas investi dans des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

L'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (n° 16).



La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 01/01/2023 au 31/12/2023

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente les quinze principaux investissements du produit financier au 31 décembre 2023.

Investissements les plus importants	Type de titre	% d'actifs	Pays
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,96 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,89 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,87 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,86 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,83 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,81 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,74 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,73 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,73 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,73 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,72 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,71 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,70 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE) RegS	Obligations d'État	0,70 %	France
FRANCE (RÉPUBLIQUE DE)	Obligations d'État	0,70 %	France



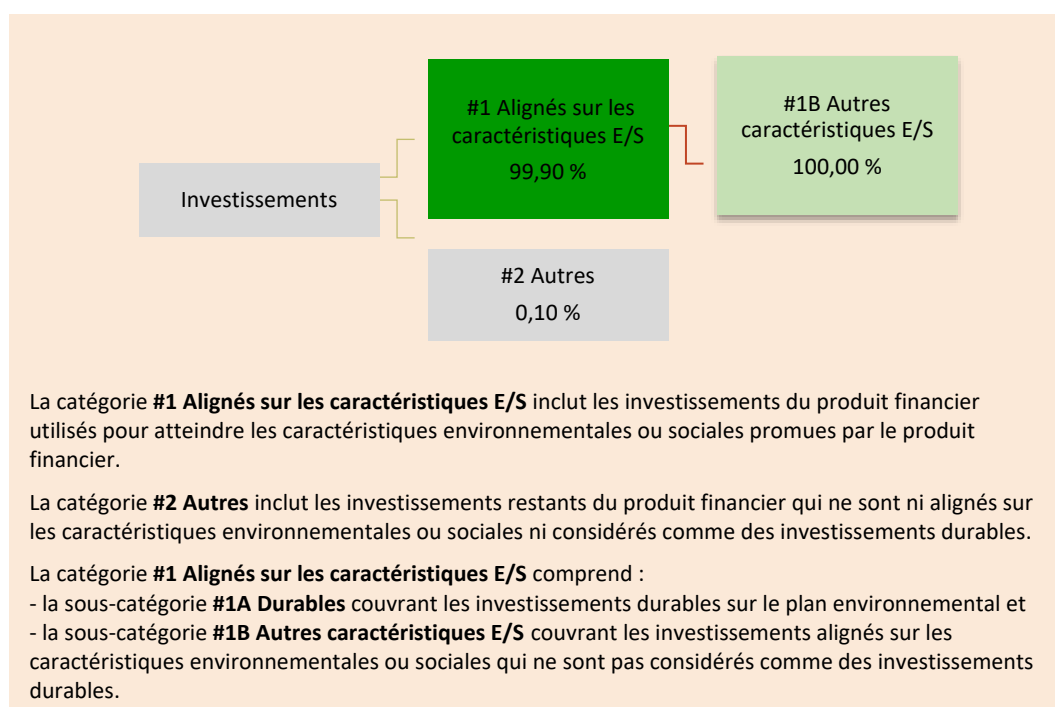
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 99,90 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

0,10 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par type de titre au 31 décembre 2023.

Type de titre	Actifs du produit financier
Obligations d'État	99,90 %
Autres / non classés	0,10 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

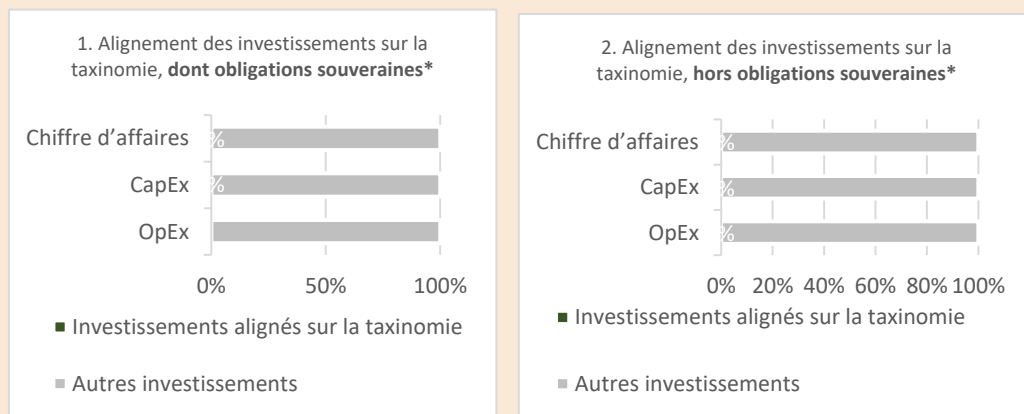
S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'effectuait pas d'allocation à des activités économiques durables contribuant à un objectif environnemental.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'effectuait pas d'allocation à des activités économiques durables contribuant à un objectif social.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts assortis ou non de sûretés (liquidités) et des actions d'autres organismes de placement collectif qui suivaient une stratégie de marché monétaire au 31 décembre 2023.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en ajustant la pondération des émissions d'obligations souveraines libellées en euro. L'Indice de référence excluait les pays classés comme « non libres » sur la base de données de Freedom House et les pays de Catégorie Risque-Pays Sustainalytics classés comme « grave ». Les obligations éligibles étaient repondérées en fonction de la Notation Risque-Pays Sustainalytics, en attribuant des pondérations plus élevées aux pays ayant une notation Risque-Pays favorable et en réduisant les pondérations des pays ayant une notation Risque-Pays moins favorable. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs bénéficiaires des investissements, destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement définissant les types et les méthodes d'engagement, les stratégies de remontée et les attentes concernant la communication avec, entre autres, DWS en tant qu'investisseur et DWS pour le compte de ses clients sur un certain nombre de sujets, y compris les critères ESG.



Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice iBoxx EUR Sovereigns ESG Tilted Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice de référence diffère d'un indice de marché large représentant la performance de l'univers des obligations souveraines libellées en euro en appliquant les critères de sélection ESG suivants :

- (1) **Freedom House Global Freedom Status** : L'Indice de référence applique des critères d'inclusion supplémentaires basés sur les données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. Dans le calcul de l'Indice de référence, seuls les pays classés « libres » ou « partiellement libres » peuvent être inclus. De plus amples informations sur la méthodologie sont disponibles sous l'en-tête « Reports » à l'adresse <https://freedomhouse.org>.
- (2) **Notation Risque-Pays Sustainalytics** : Une fois l'univers obligataire éligible défini, les pays de cet univers sont pondérés en fonction de leurs « Notations Risque-Pays Sustainalytics » relatives. La notation du risque pour un pays mesure l'ampleur du risque ESG non géré. Une notation faible indique un niveau inférieur de risque ESG non géré et une notation élevée indique un niveau supérieur de risque ESG non géré. Les pays sont ensuite regroupés dans l'une des cinq Catégories Risque-Pays (négligeable, faible, moyen, élevé, grave), comme décrit ci-dessous et selon la Notation Risque-Pays calculée. Les pondérations des émetteurs sont ensuite orientées de préférence vers les pays présentant des niveaux de risque ESG non gérés plus faibles (soit une Notation Risque-Pays plus faible) grâce à l'application d'un nouveau facteur de pondération et de la pondération préorientée de l'émetteur. Ce nouveau facteur de pondération évalue la variation de la Notation Risque-Pays de chaque émetteur par rapport à la moyenne de l'univers éligible. Le pays ayant la Notation Risque-Pays la plus basse par rapport à la moyenne se verra attribuer un nouveau facteur de pondération de 0,5 et le pays avec la Notation Risque-Pays la plus élevée par rapport à la moyenne obtiendra un nouveau facteur de pondération de 2. Un nouveau facteur de pondération est attribué aux pays compris dans cette fourchette par l'application d'une formule non linéaire relative à la variation de cet émetteur par rapport à la moyenne de la

Notation Risque-Pays. Les pondérations des pays seront ensuite normalisées pour que leur somme représente 100 %. Vous trouverez de plus amples informations sur les Notations Risque-Pays sur le site Internet de Sustainalytics (<https://www.sustainalytics.com/>) à la section ESG Risk Ratings (notations de risque ESG).

- (3) **Catégorie Risque-Pays Sustainalytics** : les Notations Risque-Pays décrites ci-dessus calculent le degré de risque ESG non géré d'un pays. Le risque non géré est mesuré sur une échelle ouverte allant de zéro (sans risque) à un score maximum inférieur à 50, pour 95 % des cas. Les émetteurs sont ensuite regroupés dans l'une des cinq catégories de risque suivantes : négligeable (0-10), faible (10-20), moyen (20-30), élevé (30-40) et grave (40+). Tous les émetteurs dont la Catégorie de Risque-Pays Sustainalytics est « grave » seront exclus de l'Indice de référence. En cas de changement de catégorie, le pays sera ajouté ou supprimé lors du rééquilibrage mensuel. De plus amples informations sur les Catégories de Risque-Pays sont disponibles sur le site Internet de Sustainalytics (<https://www.sustainalytics.com/>), dans la rubrique « ESG Risk Ratings » (notations de risque ESG).

L'Indice de référence applique des critères d'inclusion basés sur les données de Sustainalytics, qui appartient à Morningstar. Sustainalytics est une société indépendante de recherche, de notation et d'analyse ESG et de gouvernance d'entreprise de premier plan qui aide les investisseurs du monde entier à développer et mettre en œuvre des stratégies d'investissement responsables. L'Indice de référence utilise tout particulièrement les produits ESG suivants : Sustainalytics ESG Risk Rating Scores, Controversies, Country Ratings, Global Standards Screening, Product Involvement et Controversial Weapons Involvement. Pour de plus amples informations sur l'ensemble des recherches ESG de Sustainalytics des produits ESG, veuillez consulter le site : <http://www.sustainalytics.com>.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Score Freedom House	92,13	92,13
Score de pilier environnemental d'un pays	4,19	4,19
Score de pilier social d'un pays	7,53	7,53
Score de pilier de gouvernance d'un pays	7,31	7,32

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	6,82 %	6,94 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 01/01/2023 au 31/12/2023)	6,82 %	7,15 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II Target Maturity Sept 2027 EUR Corporate Bond UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 254900499HX79E7FXO75

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %



Non



Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de 26,01 % d'investissements durables (au 31/12/2023)



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2027 SRI Index (l'« Indice

de référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier favorisait particulièrement, entre autres, les caractéristiques environnementales telles que la réduction de la production de combustibles fossiles, les caractéristiques sociales liées à la réduction des controverses relatives aux droits de l'homme et au droit du travail, ainsi que la réduction de la production d'armes controversées.

Afin de promouvoir ces caractéristiques, le produit financier détenait un portefeuille de titres comprenant des composants de l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de référence était conçu pour refléter la performance du marché des obligations de sociétés à taux fixe, libellées en euro, de qualité « investment grade » et dont les dates d'échéance étaient comprises entre le 1er octobre 2026 et le 30 septembre 2027, à l'exclusion des obligations qui ne répondaient pas à des critères ESG (environnementaux, sociaux et de gouvernance) spécifiques. À compter du 1er octobre 2026, l'Indice de référence inclura également certains bons du Trésor libellés en euro émis par certains gouvernements européens assortis d'une échéance résiduelle de 1 à 3 mois.

L'Indice de référence excluait les émetteurs qui ne répondaient pas à des critères ESG spécifiques. Les émetteurs ont notamment été exclus de l'Indice de référence en raison des considérations ESG suivantes :

- Les émetteurs d'obligations de sociétés notés CCC par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs d'obligations de sociétés affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge ». La notation MSCI ESG Controversies permettait d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail
- Les émetteurs d'obligations de sociétés classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research, « BISR ») comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, les armes, le pétrole et le gaz, l'énergie nucléaire et le charbon thermique
- Les émetteurs d'obligations de sociétés impliqués dans des armes controversées, des armes nucléaires ou toutes réserves de combustibles fossiles
- Les émetteurs souverains notés B ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés

- Les émetteurs souverains classés comme « non libres » ou « partiellement libres » sur la base des données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et le BISR provenaient de MSCI ESG Research LLC.

Calcul et rééquilibrage de l'Indice de référence

À compter du 1er octobre 2026, tous les montants en numéraire reçus des obligations arrivant à échéance seront réinvestis dans des bons du Trésor libellés en euro lors du rééquilibrage de fin de mois et ne seront pas réinvestis dans de nouvelles émissions d'obligations de sociétés. Seuls les bons du Trésor libellés en euro dont les montants en circulation seront supérieurs ou égaux à 1 milliard d'euros, dont l'échéance résiduelle sera comprise entre 1 et 3 mois et qui répondront aux critères ESG applicables aux obligations souveraines énoncés ci-dessus seront éligibles.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Exposition à des controverses très graves	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés confrontées à une ou plusieurs controverses très graves en matière d'environnement, de clientèle, de droits de l'homme, de droits du travail et de gouvernance comme défini par MSCI, ce qui inclut les violations des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, ou les sociétés pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,77 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés notées « CCC », tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,77 %
Score ESG du gouvernement	moyenne pondérée du score ESG (environnemental, social et de gouvernance) souverain global de la valeur de marché du portefeuille du produit financier qui permet d'évaluer la performance globale d'un émetteur national/d'une zone géographique en termes de facteurs	0,00

	de risques environnementaux tels que mesurés par MSCI. La couverture de cet indicateur de durabilité était limitée à la part gouvernementale du portefeuille du produit financier.	
Implication dans des armes controversées	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés ayant des liens avec des armes à sous-munitions, des mines antipersonnel, des armes biologiques/chimiques, des armes à uranium appauvri, des lasers aveuglants, des armes incendiaires et/ou des armes à éclats non localisables, tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,77 %

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

S/O

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Bien que l'investissement durable n'ait pas été l'un des objectifs du produit financier, ce dernier investissait une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis par l'article 2(17) du SFDR.

Au 31 décembre 2023, 26,01 % des actifs nets du produit financier étaient investis dans des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne nuisent pas de manière significative à l'un de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements suivent des pratiques de bonne gouvernance. L'évaluation des investissements durables utilisait les données d'un ou de plusieurs fournisseurs de données et/ou sources publiques pour déterminer si une activité était durable. Les objectifs environnementaux et/ou sociaux étaient identifiés par des activités contribuant positivement aux Objectifs de développement durable des Nations unies (« ODD ») qui incluaient, notamment, (i) l'Objectif 1 : Pas de pauvreté, (ii) l'Objectif 2 : Faim « zéro », (iii) l'Objectif 3 : Bonne santé et bien-être, (iv) l'Objectif 4 : Éducation de qualité, (v) l'Objectif 5 : Égalité entre les sexes, (vi) l'Objectif 6 : Eau propre et assainissement (vii) l'Objectif 7 : Énergie propre et d'un coût abordable, (viii) l'Objectif 10 : Inégalités réduites, (ix) l'Objectif 11 : Villes et communautés durables, (x) l'Objectif 12 : Consommation et production durables, (xi) l'Objectif 13 : Mesures relatives à la lutte contre les changements climatiques, (xii) l'Objectif 14 : Vie aquatique et (xiii) l'Objectif 15 : Vie terrestre, étaient mesurés en termes de chiffre d'affaires, de dépenses d'investissement (CapEx) et/ou de dépenses d'exploitation (OpEx).

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Conformément à l'article 2(17) du SFDR, ces investissements durables ne devaient pas causer de préjudice important à des objectifs environnementaux ou sociaux, et ces émetteurs d'investissement durable devaient suivre des pratiques de bonne gouvernance. Tout investissement qui ne respectait pas les seuils liés au principe consistant à ne pas causer de préjudice important n'était pas pris en compte dans la part d'investissement durable du produit financier. Ces seuils incluaient notamment :

- l'implication dans des activités commerciales causant un préjudice ;
- la violation de normes internationales ou l'implication dans des controverses très graves ; et
- la violation de certains seuils d'indicateurs de principales incidences négatives.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres pertinents qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?

Tout titre de société qui enfreignait les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme était exclu par l'Indice de référence du produit financier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et



La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 08/11/2023 au 31/12/2023

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier au 31 décembre 2023¹.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
WELLS FARGO & COMPANY MTN RegS	Finance	0,84 %	États-Unis
SOCIETE GENERALE SA RegS	Finance	0,82 %	France
ING BANK NV MTN RegS	Finance	0,80 %	Pays-Bas
BNP PARIBAS SA	Finance	0,77 %	France

¹ Étant donné que le produit financier a été lancé le 8 novembre 2023, il n'est pas possible d'afficher une moyenne trimestrielle pour les quinze principaux investissements du produit financier.

UNICREDIT SPA MTN RegS	Finance	0,76 %	Italie
SWEDBANK AB MTN RegS	Finance	0,76 %	Suède
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE N RegS	Consommation discrétionnaire	0,75 %	Pays-Bas
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB MTN RegS	Finance	0,75 %	Suède
CREDIT AGRICOLE SA (LONDON BRANCH) MTN	Finance	0,74 %	France
DEUTSCHE BANK AG MTN RegS	Finance	0,74 %	Allemagne
ORANGE SA MTN RegS	Télécommunications	0,74 %	France
MORGAN STANLEY MTN	Finance	0,74 %	États-Unis
NORDEA BANK ABP MTN RegS	Finance	0,74 %	Finlande
INTESA SANPAOLO SPA MTN RegS	Finance	0,63 %	Italie
INTESA SANPAOLO SPA MTN RegS	Finance	0,61 %	Italie



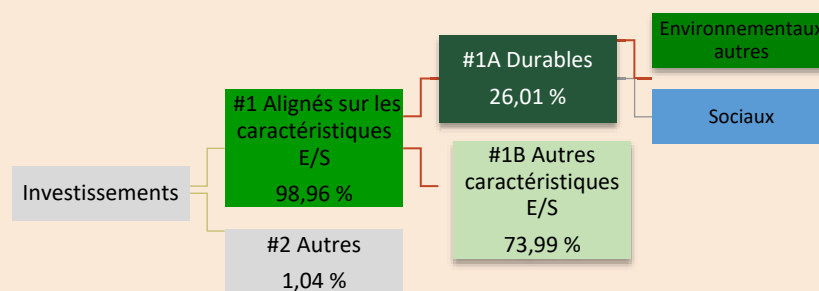
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 98,96 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S). Dans cette catégorie, 26,01 % des actifs du produit financier étaient considérés comme des investissements durables (#1A Durables).

1,04 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par secteur GICS au 31 décembre 2023.

Secteur (GICS)	Actifs du produit financier
Finance	57,10 %
Industrie	7,53 %
Consommation discrétionnaire	7,34 %
Immobilier	6,24 %
Télécommunications	6,21 %
Santé	4,60 %
Matériaux	3,73 %
Biens de consommation de base	3,58 %
Technologies de l'information	2,28 %
Services aux collectivités	1,11 %
Autres / non classés	0,27 %
Énergie	0,00 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile nucléaire** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

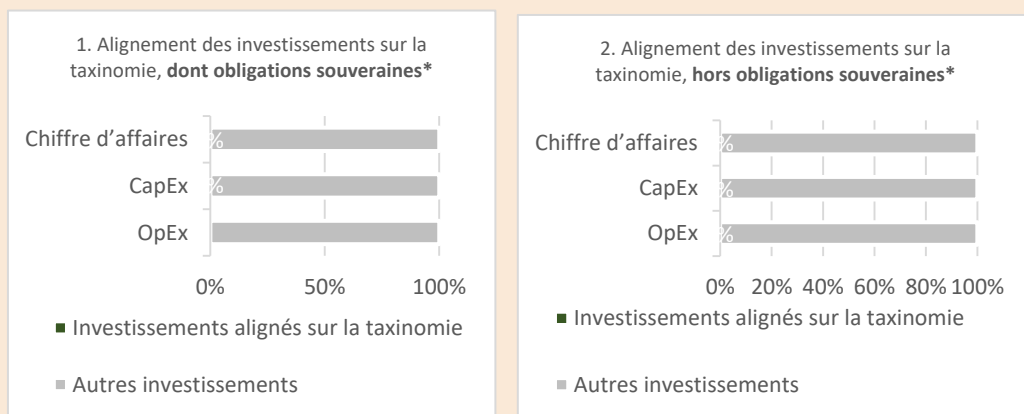
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE² ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

² Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 26,01 %.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif social. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 26,01 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts (liquidités) assortis ou non de sûretés au 31 décembre 2023. Il a également inclus des titres qui ont été récemment rétrogradés par le fournisseur de données ESG concerné, mais qui n'ont pas pu être retirés de l'Indice de référence avant son prochain rééquilibrage et qui n'avaient donc pas pu être retirés du portefeuille jusqu'à cette date.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en excluant les émetteurs qui ne répondaient pas aux critères ESG spécifiques décrits ci-dessus à chaque rééquilibrage de l'Indice de référence. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs, qui s'appuie sur le vote par procuration et l'engagement destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement et une Politique de gouvernance d'entreprise et de vote par procuration. Pour de plus amples informations concernant les activités de vote par procuration du produit financier, veuillez consulter le site <https://funds.dws.com/en-lu/about-us/corporate-governance/>.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2027 SRI Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● *En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?*

L'Indice de référence diffère d'un indice de marché large représentant la performance des obligations de sociétés libellées en euros en excluant les émetteurs qui ne répondent pas à des critères ESG spécifiques. Les émetteurs seront notamment exclus de l'Indice de référence en raison des considérations ESG suivantes :

- Les émetteurs d'obligations de sociétés notés CCC par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs d'obligations de sociétés affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge ». La notation MSCI ESG Controversies permet d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

- Les émetteurs d'obligations de sociétés classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, les armes, le pétrole et le gaz, l'énergie nucléaire et le charbon thermique
- Les émetteurs d'obligations de sociétés impliqués dans des armes controversées, des armes nucléaires ou toutes réserves de combustibles fossiles
- Les émetteurs souverains notés B ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs souverains classés comme « non libres » ou « partiellement libres » sur la base des données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et le BISR proviennent de MSCI ESG Research LLC.

Calcul et rééquilibrage de l'Indice de référence

À compter du 1er octobre 2026, tous les montants en numéraire reçus des obligations arrivant à échéance seront réinvestis dans des bons du Trésor libellés en euro lors du rééquilibrage de fin de mois et ne seront pas réinvestis dans de nouvelles émissions d'obligations de sociétés. Seuls les bons du Trésor libellés en euro dont les montants en circulation seront supérieurs ou égaux à 1 milliard d'euros, dont l'échéance résiduelle sera comprise entre 1 et 3 mois et qui répondront aux critères ESG applicables aux obligations souveraines énoncés ci-dessus seront éligibles.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Exposition à des controverses très graves	0,77 %	0,86 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	0,77 %	0,86 %
Implication dans des armes controversées	0,77 %	0,86 %
Score ESG du gouvernement	0,00	0,00

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 08/11/2023 au 31/12/2023)	3,35 %	3,33 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 08/11/2023 au 31/12/2023)	3,35 %	4,27 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II Target Maturity Sept 2029 EUR Corporate Bond UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 254900CGRW6JNIQZ0437

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de 22,21 % d'investissements durables (au 31/12/2023)

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2029 SRI Index (l'« Indice

de référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier favorisait particulièrement, entre autres, les caractéristiques environnementales telles que la réduction de la production de combustibles fossiles, les caractéristiques sociales liées à la réduction des controverses relatives aux droits de l'homme et au droit du travail, ainsi que la réduction de la production d'armes controversées.

Afin de promouvoir ces caractéristiques, le produit financier détenait un portefeuille de titres comprenant des composants de l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de référence était conçu pour refléter la performance du marché des obligations de sociétés à taux fixe, libellées en euro, de qualité « investment grade » et dont les dates d'échéance étaient comprises entre le 1er octobre 2028 et le 30 septembre 2029, à l'exclusion des obligations qui ne répondaient pas à des critères ESG (environnementaux, sociaux et de gouvernance) spécifiques. À compter du 1er octobre 2028, l'Indice de référence inclura également certains bons du Trésor libellés en euro émis par certains gouvernements européens assortis d'une échéance résiduelle de 1 à 3 mois.

L'Indice de référence excluait les émetteurs qui ne répondaient pas à des critères ESG spécifiques. Les émetteurs ont notamment été exclus de l'Indice de référence en raison des considérations ESG suivantes :

- Les émetteurs d'obligations de sociétés notés CCC par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs d'obligations de sociétés affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge ». La notation MSCI ESG Controversies permettait d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail
- Les émetteurs d'obligations de sociétés classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research, « BISR ») comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, les armes, le pétrole et le gaz, l'énergie nucléaire et le charbon thermique
- Les émetteurs d'obligations de sociétés impliqués dans des armes controversées, des armes nucléaires ou toutes réserves de combustibles fossiles
- Les émetteurs souverains notés B ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés

- Les émetteurs souverains classés comme « non libres » ou « partiellement libres » sur la base des données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et le BISR provenaient de MSCI ESG Research LLC.

Calcul et rééquilibrage de l'Indice de référence

À compter du 1er octobre 2028, tous les montants en numéraire reçus des obligations arrivant à échéance seront réinvestis dans des bons du Trésor libellés en euro lors du rééquilibrage de fin de mois et ne seront pas réinvestis dans de nouvelles émissions d'obligations de sociétés. Seuls les bons du Trésor libellés en euro dont les montants en circulation seront supérieurs ou égaux à 1 milliard d'euros, dont l'échéance résiduelle sera comprise entre 1 et 3 mois et qui répondront aux critères ESG applicables aux obligations souveraines énoncés ci-dessus seront éligibles.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Exposition à des controverses très graves	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés confrontées à une ou plusieurs controverses très graves en matière d'environnement, de clientèle, de droits de l'homme, de droits du travail et de gouvernance comme défini par MSCI, ce qui inclut les violations des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, ou les sociétés pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	1,58 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés notées « CCC », tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	1,58 %
Score ESG du gouvernement	moyenne pondérée du score ESG (environnemental, social et de gouvernance) souverain global de la valeur de marché du portefeuille du produit financier qui permet d'évaluer la performance globale d'un émetteur national/d'une zone géographique en termes de facteurs	0,00

	de risques environnementaux tels que mesurés par MSCI. La couverture de cet indicateur de durabilité était limitée à la part gouvernementale du portefeuille du produit financier.	
Implication dans des armes controversées	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés ayant des liens avec des armes à sous-munitions, des mines antipersonnel, des armes biologiques/chimiques, des armes à uranium appauvri, des lasers aveuglants, des armes incendiaires et/ou des armes à éclats non localisables, tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	1,58 %

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

S/O

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Bien que l'investissement durable n'ait pas été l'un des objectifs du produit financier, ce dernier investissait une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis par l'article 2(17) du SFDR.

Au 31 décembre 2023, 22,21 % des actifs nets du produit financier étaient investis dans des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne nuisent pas de manière significative à l'un de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements suivent des pratiques de bonne gouvernance. L'évaluation des investissements durables utilisait les données d'un ou de plusieurs fournisseurs de données et/ou sources publiques pour déterminer si une activité était durable. Les objectifs environnementaux et/ou sociaux étaient identifiés par des activités contribuant positivement aux Objectifs de développement durable des Nations unies (« ODD ») qui incluaient, notamment, (i) l'Objectif 1 : Pas de pauvreté, (ii) l'Objectif 2 : Faim « zéro », (iii) l'Objectif 3 : Bonne santé et bien-être, (iv) l'Objectif 4 : Éducation de qualité, (v) l'Objectif 5 : Égalité entre les sexes, (vi) l'Objectif 6 : Eau propre et assainissement (vii) l'Objectif 7 : Énergie propre et d'un coût abordable, (viii) l'Objectif 10 : Inégalités réduites, (ix) l'Objectif 11 : Villes et communautés durables, (x) l'Objectif 12 : Consommation et production durables, (xi) l'Objectif 13 : Mesures relatives à la lutte contre les changements climatiques, (xii) l'Objectif 14 : Vie aquatique et (xiii) l'Objectif 15 : Vie terrestre, étaient mesurés en termes de chiffre d'affaires, de dépenses d'investissement (CapEx) et/ou de dépenses d'exploitation (OpEx).

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Conformément à l'article 2(17) du SFDR, ces investissements durables ne devaient pas causer de préjudice important à des objectifs environnementaux ou sociaux, et ces émetteurs d'investissement durable devaient suivre des pratiques de bonne gouvernance. Tout investissement qui ne respectait pas les seuils liés au principe consistant à ne pas causer de préjudice important n'était pas pris en compte dans la part d'investissement durable du produit financier. Ces seuils incluaient notamment :

- l'implication dans des activités commerciales causant un préjudice ;
- la violation de normes internationales ou l'implication dans des controverses très graves ; et
- la violation de certains seuils d'indicateurs de principales incidences négatives.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres pertinents qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?

Tout titre de société qui enfreignait les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme était exclu par l'Indice de référence du produit financier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier au 31 décembre 2023¹.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
JPMORGAN CHASE & CO MTN RegS	Finance	1,41 %	États-Unis
CITIGROUP INC MTN RegS	Finance	0,96 %	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 08/11/2023 au 31/12/2023

¹ Étant donné que le produit financier a été lancé le 8 novembre 2023, il n'est pas possible d'afficher une moyenne trimestrielle pour les quinze principaux investissements du produit financier.

CAIXABANK SA RegS	Finance	0,93 %	Espagne
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE N RegS	Consommation discrétionnaire	0,91 %	Pays-Bas
CREDIT AGRICOLE SA MTN RegS	Finance	0,80 %	France
CREDIT AGRICOLE SA MTN RegS	Finance	0,80 %	France
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE N RegS	Consommation discrétionnaire	0,80 %	Pays-Bas
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL MTN	Finance	0,78 %	France
SODEXO SA RegS	Consommation discrétionnaire	0,78 %	France
PROLOGIS EURO FINANCE LLC MTN	Immobilier	0,76 %	États-Unis
CREDIT AGRICOLE SA MTN	Finance	0,76 %	France
STELLANTIS NV MTN	Consommation discrétionnaire	0,76 %	Pays-Bas
VERIZON COMMUNICATIONS INC	Télécommunications	0,74 %	États-Unis
ALLIANZ SE RegS	Finance	0,74 %	Allemagne
BNP PARIBAS SA MTN RegS	Finance	0,74 %	France



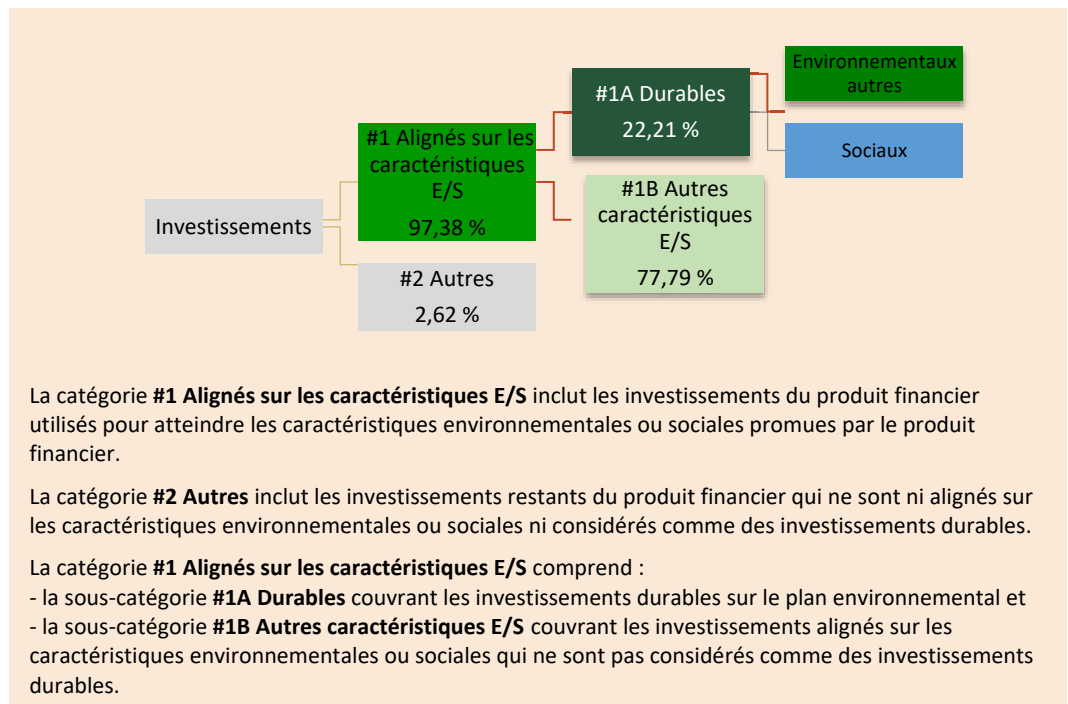
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 97,38 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S). Dans cette catégorie, 22,21 % des actifs du produit financier étaient considérés comme des investissements durables (#1A Durables).

2,62 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par secteur GICS au 31 décembre 2023.

Secteur (GICS)	Actifs du produit financier
Finance	45,12 %
Industrie	9,55 %
Consommation discrétionnaire	8,67 %
Biens de consommation de base	7,91 %
Santé	6,85 %
Télécommunications	6,53 %
Immobilier	5,62 %
Technologies de l'information	3,59 %
Matériaux	2,86 %
Services aux collectivités	1,81 %
Autres / non classés	1,03 %
Énergie	0,45 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

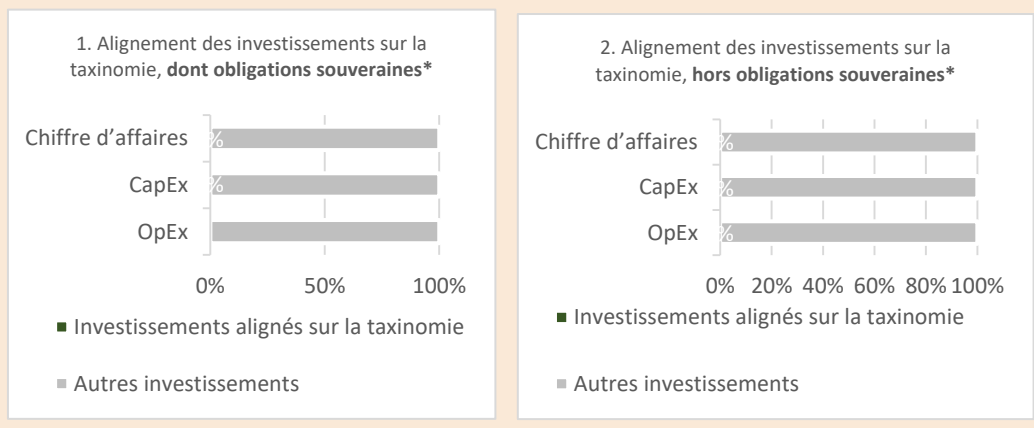
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE² ?

- Oui :
 - Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

² Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 22,21 %.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif social. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 22,21 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts (liquidités) assortis ou non de sûretés au 31 décembre 2023. Il a également inclus des titres qui ont été récemment rétrogradés par le fournisseur de données ESG concerné, mais qui n'ont pas pu être retirés de l'Indice de référence avant son prochain rééquilibrage et qui n'avaient donc pas pu être retirés du portefeuille jusqu'à cette date.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en excluant les émetteurs qui ne répondaient pas aux critères ESG spécifiques décrits ci-dessus à chaque rééquilibrage de l'Indice de référence. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs, qui s'appuie sur le vote par procuration et l'engagement destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement et une Politique de gouvernance d'entreprise et de vote par procuration. Pour de plus amples informations concernant les activités de vote par procuration du produit financier, veuillez consulter le site <https://funds.dws.com/en-lu/about-us/corporate-governance/>.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2029 SRI Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● *En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?*

L'Indice de référence diffère d'un indice de marché large représentant la performance des obligations de sociétés libellées en euros en excluant les émetteurs qui ne répondent pas à des critères ESG spécifiques. Les émetteurs seront notamment exclus de l'Indice de référence en raison des considérations ESG suivantes :

- Les émetteurs d'obligations de sociétés notés CCC par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs d'obligations de sociétés affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge ». La notation MSCI ESG Controversies permet d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

- Les émetteurs d'obligations de sociétés classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, les armes, le pétrole et le gaz, l'énergie nucléaire et le charbon thermique
- Les émetteurs d'obligations de sociétés impliqués dans des armes controversées, des armes nucléaires ou toutes réserves de combustibles fossiles
- Les émetteurs souverains notés B ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs souverains classés comme « non libres » ou « partiellement libres » sur la base des données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et le BISR proviennent de MSCI ESG Research LLC.

Calcul et rééquilibrage de l'Indice de référence

À compter du 1er octobre 2028, tous les montants en numéraire reçus des obligations arrivant à échéance seront réinvestis dans des bons du Trésor libellés en euro lors du rééquilibrage de fin de mois et ne seront pas réinvestis dans de nouvelles émissions d'obligations de sociétés. Seuls les bons du Trésor libellés en euro dont les montants en circulation seront supérieurs ou égaux à 1 milliard d'euros, dont l'échéance résiduelle sera comprise entre 1 et 3 mois et qui répondront aux critères ESG applicables aux obligations souveraines énoncés ci-dessus seront éligibles.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Exposition à des controverses très graves	1,58 %	1,30 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	1,58 %	1,30 %
Implication dans des armes controversées	1,58 %	1,30 %
Score ESG du gouvernement	0,00	0,00

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 08/11/2023 au 31/12/2023)	4,97 %	4,95 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 08/11/2023 au 31/12/2023)	4,97 %	4,27 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II Target Maturity Sept 2031 EUR Corporate Bond UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 254900DPRP5MMTZ8VL26

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %

Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de 27,23 % d'investissements durables (au 31/12/2023)

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2031 SRI Index (l'« Indice

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



de référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le produit financier favorisait particulièrement, entre autres, les caractéristiques environnementales telles que la réduction de la production de combustibles fossiles, les caractéristiques sociales liées à la réduction des controverses relatives aux droits de l'homme et au droit du travail, ainsi que la réduction de la production d'armes controversées.

Afin de promouvoir ces caractéristiques, le produit financier détenait un portefeuille de titres comprenant des composants de l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de référence était conçu pour refléter la performance du marché des obligations de sociétés à taux fixe, libellées en euro, de qualité « investment grade » et dont les dates d'échéance étaient comprises entre le 1er octobre 2030 et le 30 septembre 2031, à l'exclusion des obligations qui ne répondaient pas à des critères ESG (environnementaux, sociaux et de gouvernance) spécifiques. À compter du 1er octobre 2030, l'Indice de référence inclura également certains bons du Trésor libellés en euro émis par certains gouvernements européens assortis d'une échéance résiduelle de 1 à 3 mois.

L'Indice de référence excluait les émetteurs qui ne répondaient pas à des critères ESG spécifiques. Les émetteurs ont notamment été exclus de l'Indice de référence en raison des considérations ESG suivantes :

- Les émetteurs d'obligations de sociétés notés CCC par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs d'obligations de sociétés affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge ». La notation MSCI ESG Controversies permettait d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail
- Les émetteurs d'obligations de sociétés classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research, « BISR ») comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, les armes, le pétrole et le gaz, l'énergie nucléaire et le charbon thermique
- Les émetteurs d'obligations de sociétés impliqués dans des armes controversées, des armes nucléaires ou toutes réserves de combustibles fossiles
- Les émetteurs souverains notés B ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés

- Les émetteurs souverains classés comme « non libres » ou « partiellement libres » sur la base des données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et le BISR provenaient de MSCI ESG Research LLC.

Calcul et rééquilibrage de l'Indice de référence

À compter du 1er octobre 2030, tous les montants en numéraire reçus des obligations arrivant à échéance seront réinvestis dans des bons du Trésor libellés en euro lors du rééquilibrage de fin de mois et ne seront pas réinvestis dans de nouvelles émissions d'obligations de sociétés. Seuls les bons du Trésor libellés en euro dont les montants en circulation seront supérieurs ou égaux à 1 milliard d'euros, dont l'échéance résiduelle sera comprise entre 1 et 3 mois et qui répondront aux critères ESG applicables aux obligations souveraines énoncés ci-dessus seront éligibles.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Exposition à des controverses très graves	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés confrontées à une ou plusieurs controverses très graves en matière d'environnement, de clientèle, de droits de l'homme, de droits du travail et de gouvernance comme défini par MSCI, ce qui inclut les violations des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, ou les sociétés pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,77 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés notées « CCC », tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,77 %
Score ESG du gouvernement	moyenne pondérée du score ESG (environnemental, social et de gouvernance) souverain global de la valeur de marché du portefeuille du produit financier qui permet d'évaluer la performance globale d'un émetteur national/d'une zone géographique en termes de facteurs	0,00

	de risques environnementaux tels que mesurés par MSCI. La couverture de cet indicateur de durabilité était limitée à la part gouvernementale du portefeuille du produit financier.	
Implication dans des armes controversées	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés ayant des liens avec des armes à sous-munitions, des mines antipersonnel, des armes biologiques/chimiques, des armes à uranium appauvri, des lasers aveuglants, des armes incendiaires et/ou des armes à éclats non localisables, tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,77 %

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

S/O

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Bien que l'investissement durable n'ait pas été l'un des objectifs du produit financier, ce dernier investissait une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis par l'article 2(17) du SFDR.

Au 31 décembre 2023, 27,23 % des actifs nets du produit financier étaient investis dans des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne nuisent pas de manière significative à l'un de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements suivent des pratiques de bonne gouvernance. L'évaluation des investissements durables utilisait les données d'un ou de plusieurs fournisseurs de données et/ou sources publiques pour déterminer si une activité était durable. Les objectifs environnementaux et/ou sociaux étaient identifiés par des activités contribuant positivement aux Objectifs de développement durable des Nations unies (« ODD ») qui incluaient, notamment, (i) l'Objectif 1 : Pas de pauvreté, (ii) l'Objectif 2 : Faim « zéro », (iii) l'Objectif 3 : Bonne santé et bien-être, (iv) l'Objectif 4 : Éducation de qualité, (v) l'Objectif 5 : Égalité entre les sexes, (vi) l'Objectif 6 : Eau propre et assainissement (vii) l'Objectif 7 : Énergie propre et d'un coût abordable, (viii) l'Objectif 10 : Inégalités réduites, (ix) l'Objectif 11 : Villes et communautés durables, (x) l'Objectif 12 : Consommation et production durables, (xi) l'Objectif 13 : Mesures relatives à la lutte contre les changements climatiques, (xii) l'Objectif 14 : Vie aquatique et (xiii) l'Objectif 15 : Vie terrestre, étaient mesurés en termes de chiffre d'affaires, de dépenses d'investissement (CapEx) et/ou de dépenses d'exploitation (OpEx).

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Conformément à l'article 2(17) du SFDR, ces investissements durables ne devaient pas causer de préjudice important à des objectifs environnementaux ou sociaux, et ces émetteurs d'investissement durable devaient suivre des pratiques de bonne gouvernance. Tout investissement qui ne respectait pas les seuils liés au principe consistant à ne pas causer de préjudice important n'était pas pris en compte dans la part d'investissement durable du produit financier. Ces seuils incluaient notamment :

- l'implication dans des activités commerciales causant un préjudice ;
- la violation de normes internationales ou l'implication dans des controverses très graves ; et
- la violation de certains seuils d'indicateurs de principales incidences négatives.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres pertinents qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?

Tout titre de société qui enfreignait les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme était exclu par l'Indice de référence du produit financier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 08/11/2023 au 31/12/2023

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier au 31 décembre 2023¹.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
INTESA SANPAOLO SPA MTN RegS	Finance	1,92 %	Italie
JPMORGAN CHASE & CO MTN RegS	Finance	1,79 %	États-Unis

¹ Étant donné que le produit financier a été lancé le 8 novembre 2023, il n'est pas possible d'afficher une moyenne trimestrielle pour les quinze principaux investissements du produit financier.

STELLANTIS NV MTN	Consommation discrétionnaire	1,34 %	Pays-Bas
CREDIT AGRICOLE SA MTN RegS	Finance	1,34 %	France
BNP PARIBAS SA MTN RegS	Finance	1,34 %	France
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CO RegS	Technologies de l'information	1,34 %	États-Unis
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ RegS	Industrie	1,32 %	Pays-Bas
MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL FINANC MTN RegS	Consommation discrétionnaire	1,26 %	Pays-Bas
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD RegS	Santé	1,25 %	Japon
MORGAN STANLEY RegS	Finance	1,22 %	États-Unis
ING GROEP NV MTN RegS	Finance	1,21 %	Pays-Bas
SAP SE RegS	Technologies de l'information	1,20 %	Allemagne
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE N RegS	Consommation discrétionnaire	1,19 %	Pays-Bas
THERMO FISHER SCIENTIFIC (FINAN)	Santé	1,10 %	Pays-Bas
BANK OF AMERICA CORP MTN RegS	Finance	1,07 %	États-Unis



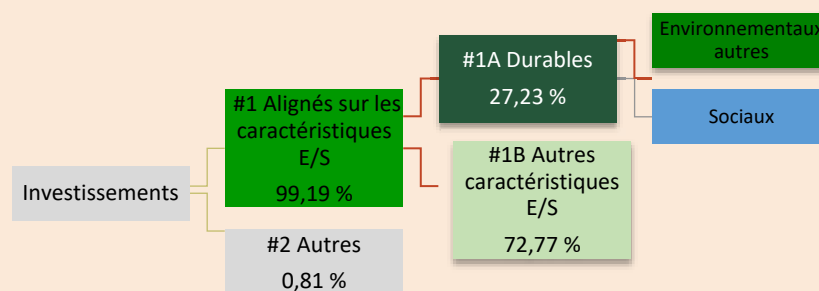
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 99,19 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S). Dans cette catégorie, 27,23 % des actifs du produit financier étaient considérés comme des investissements durables (#1A Durables).

0,81 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par secteur GICS au 31 décembre 2023.

Secteur (GICS)	Actifs du produit financier
Finance	40,64 %
Industrie	10,76 %
Immobilier	8,48 %
Télécommunications	8,00 %
Consommation discrétionnaire	7,56 %
Santé	7,31 %
Biens de consommation de base	5,96 %
Technologies de l'information	5,70 %
Matériaux	3,16 %
Services aux collectivités	1,95 %
Énergie	0,44 %
Autres / non classés	0,04 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

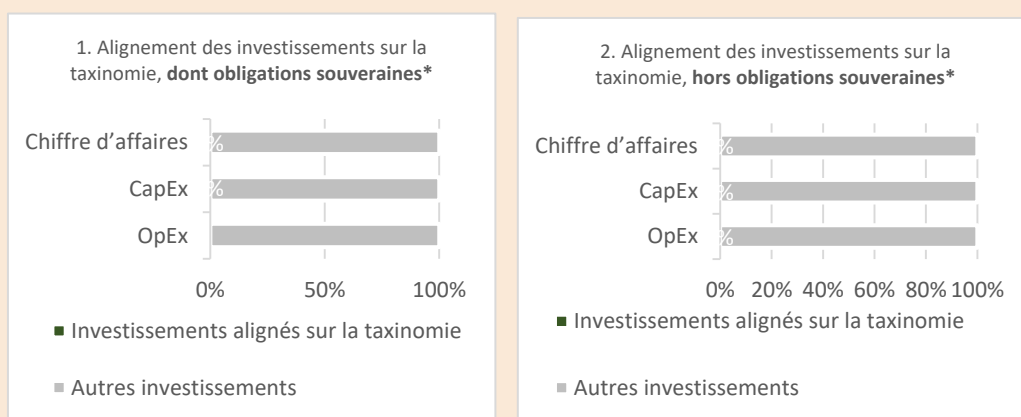
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE² ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

² Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 27,23 %.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif social. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 27,23 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts (liquidités) assortis ou non de sûretés au 31 décembre 2023. Il a également inclus des titres qui ont été récemment rétrogradés par le fournisseur de données ESG concerné, mais qui n'ont pas pu être retirés de l'Indice de référence avant son prochain rééquilibrage et qui n'avaient donc pas pu être retirés du portefeuille jusqu'à cette date.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en excluant les émetteurs qui ne répondaient pas aux critères ESG spécifiques décrits ci-dessus à chaque rééquilibrage de l'Indice de référence. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct », ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs, qui s'appuie sur le vote par procuration et l'engagement destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement et une Politique de gouvernance d'entreprise et de vote par procuration. Pour de plus amples informations concernant les activités de vote par procuration du produit financier, veuillez consulter le site <https://funds.dws.com/en-lu/about-us/corporate-governance/>.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2031 SRI Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● *En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?*

L'Indice de référence diffère d'un indice de marché large représentant la performance des obligations de sociétés libellées en euros en excluant les émetteurs qui ne répondent pas à des critères ESG spécifiques. Les émetteurs seront notamment exclus de l'Indice de référence en raison des considérations ESG suivantes :

- Les émetteurs d'obligations de sociétés notés CCC par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs d'obligations de sociétés affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge ». La notation MSCI ESG Controversies permet d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

- Les émetteurs d'obligations de sociétés classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, les armes, le pétrole et le gaz, l'énergie nucléaire et le charbon thermique
- Les émetteurs d'obligations de sociétés impliqués dans des armes controversées, des armes nucléaires ou toutes réserves de combustibles fossiles
- Les émetteurs souverains notés B ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs souverains classés comme « non libres » ou « partiellement libres » sur la base des données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et le BISR proviennent de MSCI ESG Research LLC.

Calcul et rééquilibrage de l'Indice de référence

À compter du 1er octobre 2030, tous les montants en numéraire reçus des obligations arrivant à échéance seront réinvestis dans des bons du Trésor libellés en euro lors du rééquilibrage de fin de mois et ne seront pas réinvestis dans de nouvelles émissions d'obligations de sociétés. Seuls les bons du Trésor libellés en euro dont les montants en circulation seront supérieurs ou égaux à 1 milliard d'euros, dont l'échéance résiduelle sera comprise entre 1 et 3 mois et qui répondront aux critères ESG applicables aux obligations souveraines énoncés ci-dessus seront éligibles.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Exposition à des controverses très graves	0,77 %	0,53 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	0,77 %	0,53 %
Implication dans des armes controversées	0,77 %	0,53 %
Score ESG du gouvernement	0,00	0,00

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 08/11/2023 au 31/12/2023)	6,01 %	6,04 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 08/11/2023 au 31/12/2023)	6,01 %	4,27 %

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Xtrackers II Target Maturity Sept 2033 EUR Corporate Bond UCITS ETF
 Identifiant d'entité juridique : 254900Q8IL21HGJ73745

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



Oui

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %



Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il contenait une proportion de 21,87 % d'investissements durables (au 31/12/2023)

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le produit financier promouvait des caractéristiques environnementales et sociales et pouvait être considéré comme un produit financier soumis à l'article 8(1) du SFDR en répliquant l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2033 SRI Index (l'« Indice de référence »), qui incluait des considérations environnementales et/ou sociales. Le

produit financier favorisait particulièrement, entre autres, les caractéristiques environnementales telles que la réduction de la production de combustibles fossiles, les caractéristiques sociales liées à la réduction des controverses relatives aux droits de l'homme et au droit du travail, ainsi que la réduction de la production d'armes controversées.

Afin de promouvoir ces caractéristiques, le produit financier détenait un portefeuille de titres comprenant des composants de l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. L'Indice de référence était conçu pour refléter la performance du marché des obligations de sociétés à taux fixe, libellées en euro, de qualité « investment grade » et dont les dates d'échéance étaient comprises entre le 1er octobre 2032 et le 30 septembre 2033, à l'exclusion des obligations qui ne répondaient pas à des critères ESG (environnementaux, sociaux et de gouvernance) spécifiques. À compter du 1er octobre 2032, l'Indice de référence inclura également certains bons du Trésor libellés en euro émis par certains gouvernements européens assortis d'une échéance résiduelle de 1 à 3 mois.

L'Indice de référence excluait les émetteurs qui ne répondaient pas à des critères ESG spécifiques. Les émetteurs ont notamment été exclus de l'Indice de référence en raison des considérations ESG suivantes :

- Les émetteurs d'obligations de sociétés notés CCC par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs d'obligations de sociétés affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge ». La notation MSCI ESG Controversies permettait d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail
- Les émetteurs d'obligations de sociétés classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research, « BISR ») comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, les armes, le pétrole et le gaz, l'énergie nucléaire et le charbon thermique
- Les émetteurs d'obligations de sociétés impliqués dans des armes controversées, des armes nucléaires ou toutes réserves de combustibles fossiles
- Les émetteurs souverains notés B ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissaient des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prenaient en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs souverains classés comme « non libres » ou « partiellement libres » sur la base des données de Freedom House. Freedom House est une

organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et le BISR provenaient de MSCI ESG Research LLC.

Calcul et rééquilibrage de l'Indice de référence

À compter du 1er octobre 2032, tous les montants en numéraire reçus des obligations arrivant à échéance seront réinvestis dans des bons du Trésor libellés en euro lors du rééquilibrage de fin de mois et ne seront pas réinvestis dans de nouvelles émissions d'obligations de sociétés. Seuls les bons du Trésor libellés en euro dont les montants en circulation seront supérieurs ou égaux à 1 milliard d'euros, dont l'échéance résiduelle sera comprise entre 1 et 3 mois et qui répondront aux critères ESG applicables aux obligations souveraines énoncés ci-dessus seront éligibles.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Indicateur	Description	Performance (au 31/12/2023)
Exposition à des controverses très graves	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés confrontées à une ou plusieurs controverses très graves en matière d'environnement, de clientèle, de droits de l'homme, de droits du travail et de gouvernance comme défini par MSCI, ce qui inclut les violations des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, ou les sociétés pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,00 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés notées « CCC », tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,00 %
Score ESG du gouvernement	moyenne pondérée du score ESG (environnemental, social et de gouvernance) souverain global de la valeur de marché du portefeuille du produit financier qui permet d'évaluer la performance globale d'un émetteur national/d'une zone géographique en termes de facteurs de risques environnementaux tels que mesurés par MSCI. La couverture de cet indicateur de durabilité était limitée	0,00

	à la part gouvernementale du portefeuille du produit financier (le cas échéant).	
Implication dans des armes controversées	Pourcentage de la valeur de marché du portefeuille du produit financier exposée à des sociétés ayant des liens avec des armes à sous-munitions, des mines antipersonnel, des armes biologiques/chimiques, des armes à uranium appauvri, des lasers aveuglants, des armes incendiaires et/ou des armes à éclats non localisables, tel que déterminé par MSCI, ou pour lesquelles aucune donnée n'était disponible.	0,00 %

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

S/O

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Bien que l'investissement durable n'ait pas été l'un des objectifs du produit financier, ce dernier investissait une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis par l'article 2(17) du SFDR.

Au 31 décembre 2023, 21,87 % des actifs nets du produit financier étaient investis dans des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, au sens de l'article 2(17) du SFDR. Les activités économiques durables font référence à la part des activités économiques d'un émetteur qui contribuent à un objectif environnemental et/ou social, à condition que ces investissements ne nuisent pas de manière significative à l'un de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements suivent des pratiques de bonne gouvernance. L'évaluation des investissements durables utilisait les données d'un ou de plusieurs fournisseurs de données et/ou sources publiques pour déterminer si une activité était durable. Les objectifs environnementaux et/ou sociaux étaient identifiés par des activités contribuant positivement aux Objectifs de développement durable des Nations unies (« ODD ») qui incluaient, notamment, (i) l'Objectif 1 : Pas de pauvreté, (ii) l'Objectif 2 : Faim « zéro », (iii) l'Objectif 3 : Bonne santé et bien-être, (iv) l'Objectif 4 : Éducation de qualité, (v) l'Objectif 5 : Égalité entre les sexes, (vi) l'Objectif 6 : Eau propre et assainissement (vii) l'Objectif 7 : Énergie propre et d'un coût abordable, (viii) l'Objectif 10 : Inégalités réduites, (ix) l'Objectif 11 : Villes et communautés durables, (x) l'Objectif 12 : Consommation et production durables, (xi) l'Objectif 13 : Mesures relatives à la lutte contre les changements climatiques, (xii) l'Objectif 14 : Vie aquatique et (xiii) l'Objectif 15 : Vie terrestre, étaient mesurés en termes de chiffre d'affaires, de dépenses d'investissement (CapEx) et/ou de dépenses d'exploitation (OpEx).

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Conformément à l'article 2(17) du SFDR, ces investissements durables ne devaient pas causer de préjudice important à des objectifs environnementaux ou sociaux, et ces émetteurs d'investissement durable devaient suivre des pratiques de bonne gouvernance. Tout investissement qui ne respectait pas les seuils liés au principe consistant à ne pas causer de préjudice important n'était pas pris en compte dans la part d'investissement durable du produit financier. Ces seuils incluaient notamment :

- l'implication dans des activités commerciales causant un préjudice ;
- la violation de normes internationales ou l'implication dans des controverses très graves ; et
- la violation de certains seuils d'indicateurs de principales incidences négatives.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres pertinents qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?

Tout titre de société qui enfreignait les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme était exclu par l'Indice de référence du produit financier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Dans le cadre de l'évaluation du principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu de l'article 2(17) du SFDR, l'évaluation des investissements durables intégrait certains indicateurs liés aux principales incidences négatives, et l'Indice de référence du produit financier comprenait des critères visant à exclure les titres qui étaient négativement alignés sur les indicateurs de principales incidences négatives suivants, ou à réduire l'exposition à de tels titres :

- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles (n° 4) ;
- violation des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales (n° 10) ;
- exposition à des armes controversées (n° 14) ; et



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 08/11/2023 au 31/12/2023

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Le tableau ci-dessous présente la moyenne des quinze principaux investissements du produit financier au 31 décembre 2023¹.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
FRANCE TÉLÉCOM MTN	Télécommunications	2,81 %	France
MORGAN STANLEY RegS	Finance	2,11 %	États-Unis
ING GROEP NV RegS	Finance	2,01 %	Pays-Bas

¹ Étant donné que le produit financier a été lancé le 8 novembre 2023, il n'est pas possible d'afficher une moyenne trimestrielle pour les quinze principaux investissements du produit financier.

DEUTSCHE BOERSE AG RegS	Finance	1,97 %	Allemagne
AT&T INC	Télécommunications	1,85 %	États-Unis
AXA SA MTN RegS	Finance	1,57 %	France
BNP PARIBAS SA RegS	Finance	1,43 %	France
CREDIT SUISSE GROUP AG MTN RegS	Finance	1,40 %	Suisse
HANNOVER RUECK SE RegS	Finance	1,39 %	Allemagne
BARCLAYS PLC MTN RegS	Finance	1,38 %	Royaume-Uni
ALLIANZ SE RegS	Finance	1,37 %	Allemagne
NESTLÉ FINANCE INTERNATIONAL LTD MTN RegS	Biens de consommation de base	1,35 %	Luxembourg
ASSICURAZIONI GENERALI SPA MTN RegS	Finance	1,35 %	Italie
SOCIETE GENERALE SA MTN RegS	Finance	1,35 %	France
PROLOGIS EURO FINANCE LLC RegS	Immobilier	1,34 %	États-Unis



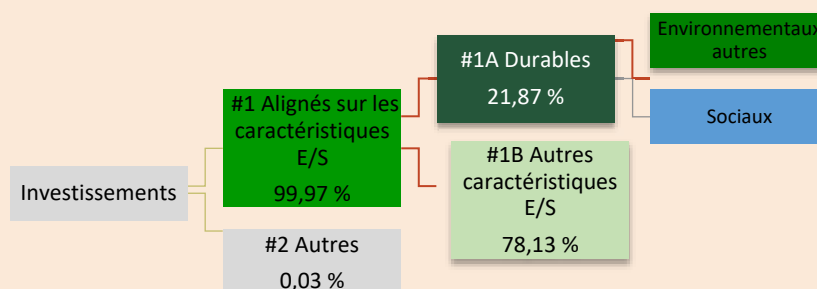
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2023, ce produit financier investissait 99,97 % de ses actifs nets dans des investissements conformes aux caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S). Dans cette catégorie, 21,87 % des actifs du produit financier étaient considérés comme des investissements durables (#1A Durables).

0,03 % des investissements n'étaient pas alignés sur ces caractéristiques (#2 Autres).



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau ci-dessous résume les investissements du produit financier par secteur GICS au 31 décembre 2023.

Secteur (GICS)	Actifs du produit financier
Finance	43,18 %
Industrie	12,52 %
Télécommunications	9,53 %
Consommation discrétionnaire	9,25 %
Biens de consommation de base	8,76 %
Immobilier	6,79 %
Santé	3,29 %
Services aux collectivités	3,24 %
Matériaux	2,10 %
Énergie	0,68 %
Technologies de l'information	0,63 %
Autres / non classés	0,03 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

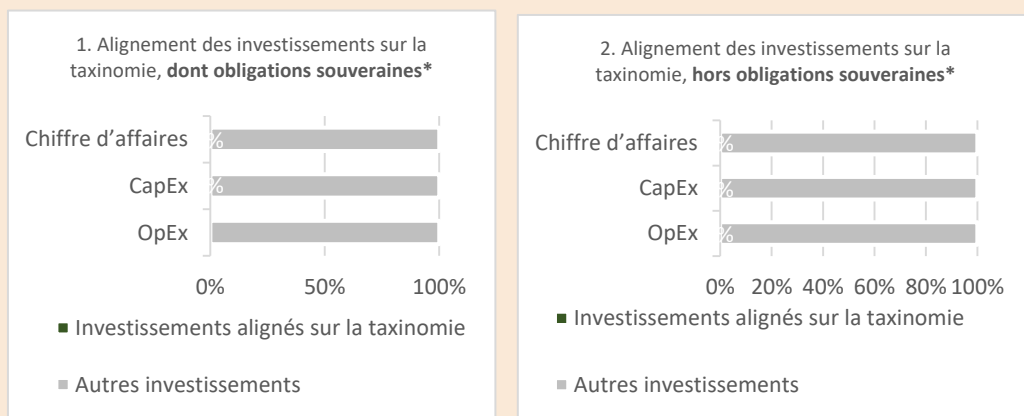
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements durables sur le plan environnemental conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été conformes à l'objectif environnemental du Règlement sur la taxinomie.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE² ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

² Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

S/O – Il n'existait pas de proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE. En conséquence, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes conformément au règlement (UE) 2020/852 (Règlement sur la taxinomie) est considérée comme représentant 0 % des actifs du produit financier. Il est néanmoins possible que certains investissements durables aient été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif environnemental. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 21,87 %.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Le produit financier n'envisageait pas d'allouer un minimum à des activités économiques durables qui contribuent à un objectif social. Cependant, au 31 décembre 2023, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social était en tout de 21,87 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Le produit financier promouvait essentiellement une allocation d'actifs dans des investissements conformes à des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés sur les caractéristiques E/S).

Les investissements appartenant à la catégorie « #2 Autres » comprenaient des dépôts (liquidités) assortis ou non de sûretés au 31 décembre 2023.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

L'Indice de référence promouvait des caractéristiques environnementales et sociales en excluant les émetteurs qui ne répondaient pas aux critères ESG spécifiques décrits ci-dessus à chaque rééquilibrage de l'Indice de référence. Afin d'atteindre l'objectif d'investissement, le produit financier adoptait une « Politique d'investissement direct »,

ce qui signifie que le produit financier visait à répliquer l'Indice de référence en achetant tout ou partie des titres compris dans l'Indice de référence ou des valeurs mobilières non associées ou d'autres actifs éligibles. Toute valeur mobilière non associée qui était détenue par le produit financier était généralement similaire aux valeurs comprises dans l'Indice de référence.

L'engagement actif auprès des émetteurs bénéficiaires des investissements, destiné à induire un changement au profit des clients, est un élément clé de l'approche du Groupe DWS en matière d'investissement durable. DWS appliquait une politique d'engagement et une Politique de gouvernance d'entreprise et de vote par procuration. Pour de plus amples informations concernant les activités de vote par procuration du produit financier, veuillez consulter le site <https://funds.dws.com/en-lu/about-us/corporate-governance/>.



Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Le produit financier a désigné l'indice Bloomberg MSCI Euro Corporate September 2033 SRI Index comme indice de référence. La comparaison des performances entre le produit financier et l'indice de référence est présentée ci-dessous.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice de référence diffère d'un indice de marché large représentant la performance des obligations de sociétés libellées en euros en excluant les émetteurs qui ne répondent pas à des critères ESG spécifiques. Les émetteurs seront notamment exclus de l'Indice de référence en raison des considérations ESG suivantes :

- Les émetteurs d'obligations de sociétés notés CCC par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs d'obligations de sociétés affichant une notation MSCI ESG Controversies Score « Rouge ». La notation MSCI ESG Controversies permet d'identifier les sociétés impliquées dans des controverses ESG graves, définies selon des conventions et normes internationales, telles que, mais sans s'y limiter, le Pacte mondial des Nations unies, la Déclaration universelle des droits de l'homme et la Déclaration de l'OIT relative aux principes et droits fondamentaux au travail
- Les émetteurs d'obligations de sociétés classés par MSCI dans le cadre de la recherche sur l'implication des entreprises (Business Involvement Screening Research) comme étant en violation de certains seuils de revenus dans des activités controversées, y compris, mais sans s'y limiter, l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, les divertissements pour adultes, les organismes génétiquement modifiés, les armes à feu civiles, les armes, le pétrole et le gaz, l'énergie nucléaire et le charbon thermique

- Les émetteurs d'obligations de sociétés impliqués dans des armes controversées, des armes nucléaires ou toutes réserves de combustibles fossiles
- Les émetteurs souverains notés B ou moins par MSCI ESG Research LLC. Les notations MSCI ESG fournissent des scores pour mesurer les caractéristiques ESG d'un émetteur par rapport à ses pairs et prennent en compte les questions environnementales, sociales et de gouvernance clés
- Les émetteurs souverains classés comme « non libres » ou « partiellement libres » sur la base des données de Freedom House. Freedom House est une organisation non gouvernementale à but non lucratif qui mène des recherches et des activités de plaidoyer sur la démocratie, la liberté politique et les droits de l'homme. Freedom House classe les pays dans le cadre de son rapport intitulé « Freedom in the World » (Liberté dans le monde) comme étant « libres », « partiellement libres » ou « non libres ». Freedom House classe chaque pays en fonction de ses recherches. De plus amples informations sont disponibles sur <https://freedomhouse.org>.

Les notations MSCI ESG, les MSCI ESG Controversies Scores et le BISR proviennent de MSCI ESG Research LLC.

Calcul et rééquilibrage de l'Indice de référence

À compter du 1er octobre 2032, tous les montants en numéraire reçus des obligations arrivant à échéance seront réinvestis dans des bons du Trésor libellés en euro lors du rééquilibrage de fin de mois et ne seront pas réinvestis dans de nouvelles émissions d'obligations de sociétés. Seuls les bons du Trésor libellés en euro dont les montants en circulation seront supérieurs ou égaux à 1 milliard d'euros, dont l'échéance résiduelle sera comprise entre 1 et 3 mois et qui répondront aux critères ESG applicables aux obligations souveraines énoncés ci-dessus seront éligibles.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Indicateurs (tels que décrits ci-dessus)	Performance du produit financier (au 31/12/2023)	Performance de l'indice de référence (au 31/12/2023)
Exposition à des controverses très graves	0,00 %	0,00 %
Exposition aux émetteurs les moins performants de leur catégorie	0,00 %	0,00 %
Implication dans des armes controversées	0,00 %	0,00 %
Score ESG du gouvernement	0,00	0,00

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

	Produit financier	Indice de référence
Performance (au cours de la période du 08/11/2023 au 31/12/2023)	7,01 %	7,10 %

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

	Produit financier	Indice de marché large
Performance (au cours de la période du 08/11/2023 au 31/12/2023)	7,01 %	4,27 %