

Dieses Informationsblatt entspricht dem Stand vom 28. März 2024, sofern nicht anders angegeben.

Xtrackers II iTraxx Crossover Short Daily Swap UCITS ETF 1C

ein Teilfonds von Xtrackers II

Überblick

- Investition in iTraxx credit default swaps (CDS)
- CDS von hochverzinslichen Unternehmen

Eigenschaften vom Index

Der Markt iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX zielt darauf ab, die Wertentwicklung des folgenden Markts abzubilden:

- Short 5-jährige CDS von europäischen Körperschaften (reines Kreditengagement, finanzierte CDS-Position)
- nur Unternehmen ohne Investment-Grade-Rating
- Referenz-Körperschaften, die zulässig sind, haben einen Spread von mindestens dem Zweifachen des durchschnittlichen Spreads der Bestandteile des iTraxx Non-Financial Index.
- 75 europäische Körperschaften auf Basis des höchsten Liquiditätsrangs
- Alle Bestandteile sind gleich gewichtet.

Die Performance dieses Index wird von drei Faktoren bestimmt: abzüglich der laufenden Rendite des CDS (Carry), abzüglich der Änderung der CDS-Preise und der laufenden Rendite aus der Finanzierungs-Komponente (Euro short term rate-Satz).

Weitere Informationen zum Index und zur allgemeinen Methodik hinter den iTraxx-Indizes sind auf der Markt iBoxx-Website verfügbar (www.markit.com).

Risiken von Exchange Traded Funds (ETFs)

- Der Fonds ist nicht kapitalgeschützt. Der Wert Ihrer Investition kann sowohl sinken als auch steigen. Die bisherige Wertentwicklung ist kein zuverlässiger Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.
- Der Fonds ist den Bewegungen an den Märkten in einem einzelnen Land oder einer einzelnen Region ausgesetzt, die durch politische bzw. wirtschaftliche Entwicklungen, staatliche Maßnahmen oder Naturereignisse nachteilig beeinflusst werden können, von denen ein breiter diversifizierter Fonds nicht beeinträchtigt wäre.
- Der Fonds schließt ein Derivategeschäft mit einer Vertragspartei ab. Falls die Vertragspartei keine Zahlungen leisten kann (zum Beispiel im Falle einer Insolvenz), kann dies zu einem Verlust in Ihrer Anlage führen.
- Der Index soll die Wertentwicklung einer negativen Position (als Short-Position bekannt) in Bezug auf den zugrunde liegenden Index abbilden. Der Stand des Index dürfte somit steigen, wenn der zugrunde liegende Index fällt, und fallen, wenn der zugrunde liegende Index steigt. Die Abbildung durch den Index erfolgt nur auf täglicher Basis, was nicht mit dem Ziel einer Verkaufsposition für einen längeren Zeitraum als einen Tag gleichzusetzen ist. Die Wertentwicklung des Fonds über längere Zeiträume als einen Tag ist unter Umständen nicht umgekehrt proportional oder symmetrisch zu den Renditen des zugrunde liegenden Index.
- Der Index ist an den Wert und/oder die Rendite bestimmter Kreditderivate-Transaktionen gekoppelt, der bzw. die sinken kann/können. Die Märkte für diese Anlageklassen können gelegentlich volatil oder illiquide sein. Der Index kann hiervon betroffen sein.

Fondsinformationen	
ISIN	LU0321462870
Währung der Anteilsklasse	EUR
Fondswährung	EUR
Auflegungstermin des Fonds	07. November 2007
Gesellschaftssitz	Luxemburg
Portfoliomethode	Substitute Basket + Swap
Portfoliointerverwalter	DWS Investments UK Ltd
Anlageverwalter	DWS Investments UK Ltd
Verwahrstelle	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Pauschalgebühr ¹	0,24% p.a.
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Aktive Swap-Kontrahenten	Deutsche Bank AG
Nettoinventarwert (NAV)	EUR 31,49
Fondsvermögen	EUR 28,45 Mio.
Im Umlauf befindliche Anteile insgesamt	903.656,00
Index Name	Markt iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX

¹ Weitere Informationen / Glossar finden Sie hier.

Notierungs- und Handelsinformationen			
Börse	Bloomberg Ticker	Reuters RIC	Handelswährung
XETRA	XTC5 GY	XTC5.DE	EUR
Borsa Italiana	XTC5 IM	XTC5.MI	EUR

Angaben zur kumulierten Wertentwicklung						
	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	Annualisierte Volatilität
Anteilsklassen	-0,18%	-0,29%	-5,44%	-7,54%	-13,79%	8,29%
Index	-0,16%	-0,23%	-5,33%	-7,32%	-13,18%	8,23%
Tracking-Abweichung	-0,02%	-0,06%	-0,11%	-0,22%	-0,61%	-
Tracking Error	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	-

Angaben zur Wertentwicklung im Kalenderjahr						
	2019	2020	2021	2022	2023	YTD
Anteilsklassen	-9,52%	-4,79%	-7,01%	2,02%	-10,89%	-0,29%
Index	-9,30%	-4,56%	-6,78%	2,26%	-10,68%	-0,23%
Tracking-Abweichung	-0,22%	-0,23%	-0,23%	-0,24%	-0,21%	-0,06%
Tracking Error	0,19%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%

Angaben zur rollierenden Wertentwicklung												
	3/14 - 3/15	3/15 - 3/16	3/16 - 3/17	3/17 - 3/18	3/18 - 3/19	3/19 - 3/20	3/20 - 3/21	3/21 - 3/22	3/22 - 3/23	3/23 - 3/24	Seit Auflage	
Anteilsklassen	-10,47%	-1,04%	-7,49%	-8,35%	-3,78%	8,58%	-18,06%	-3,15%	-3,73%	-7,54%	-6,96%	
Index	-10,25%	-0,80%	-7,26%	-8,13%	-3,55%	8,84%	-17,86%	-2,92%	-3,50%	-7,32%	-6,73%	
Tracking-Abweichung	-0,22%	-0,24%	-0,23%	-0,22%	-0,23%	-0,26%	-0,20%	-0,23%	-0,22%	-0,22%	-0,08%	
Tracking Error	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,20%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,54%	



Quelle: DWS, Indexanbieter

Dieses Informationsblatt entspricht dem Stand vom 28. März 2024, sofern nicht anders angegeben.

Index information	
Index Name	Markit iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX
Index Provider	Markit Indices Limited
Bloomberg Symbol	ITRXXS5I
Indextyp	Brutto-Gesamttrendite
Index Basiswährung	EUR
Anzahl Aktien im Index	75
Häufigkeit der Index-Neugewichtung	Halbjährlich
Aktueller Spread (in bps)	562

Quelle: Indexanbieter

Mehr Informationen zu Xtrackers

DWS International GmbH | Xtrackers Info: etf.Xtrackers.com
 Team E-Mail: xtrackers@dws.com
 Mainzer Landstrasse 11-17
 60329 Frankfurt am Main
 Hotline: +49 69 910 30549

Bestandteile des Markit iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX					
Referenzwert	Spread in BP	Referenzwert	Spread in BP	Referenzwert	Spread in BP
ATOS SE 11/28 AV387914	18.235	Novafives S.A.S. 6/25	332	Constellium NV 2/26	172
Intrum Justitia AB 7/24	1.662	BBG012V24F52 ILIAD HOLDING SAS SR SECURED REGS 10/28 5.625 10/28	328	VOLVO CAR AB	171
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 1.750% 2025-01-14	1.449	CW Sr Fin Ltd	312	UPC Holding B.V.	171
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 5/24	1.296	Ziggo Bond Finance BV 1/25	306	Premier Foods Finance PLC	169
Numericable Group SA 5/24	876	CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH	304	SCHAEFFLER AG 03/24 AX751866	163
ADLER Real Estate AG 12/21	728	BBG0152D25Y5 ALLWYN ENTERTAINMENT FIN 02/28 1 2/28	292	ThyssenKrupp AG 2/25	160
Boparan Finance PLC	581	METRO AG 10/21 EUR33459	292	DUFREY ONE BV	152
Iceland Bondco PLC	555	BBG012R3Z7K2 KAIXO BONDSCO TELECOM SAU 9/29	291	RENAULT 3/21	144
3.25 Bellis26Nts -S	524	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	288	AUTOSTRAD SPA 02/25 EUR54744	144
EG GLOBAL FINANCE PLC SR SECURED REGS 10/25 6.25	523	BBG014LLWV97 WEBUILD SPA 7/26	270	Nidda Healthcare Holding GmbH 9/24	139
Altice Finco S.A.	523	EP INFRASTRUCTURE AS 1.659% 2024-04-26	252	Crown European Holdings SA 5/25	136
BBG00YZ4R632 INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 1/26	508	BBG0100PWW51 NEXI SPA 4/26	251	Cleopatra Finance Ltd 2/23	126
Grifols SA 5/25	502	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC	244	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE ORD SHS	118
MOTION BONDSCO DAC SR SECURED REGS 11/27 4.5	494	3.15 TECHNIP 23	242	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 0.25% 06/09/2024 9/24	117
Stonegate Pub Company Financing PLC	473	PIRELLI/FORVIA/TESLA	238	Cellnex Telecom SA 7/22	115
INEOS Group Holdings SA 8/24	418	Hapag-Lloyd AG 7/24	229	ERICSSON LM 05/22	114
CITYCON TREASURY BV 09/26 EUR52987	406	Stena Aktiebolag	226	Rexel SA 6/25	106
VERTICAL HOLDCO GMBH 7/28	406	Matterhorn Telecom Holding SA 5/23	215	Elis 4/24	106
Loxam SAS 4/25	398	Saipem Finance International BV 9/23	214	BBG00NSG83Y1	105
Monitchem Holdco 3 S.A.	389	OI European Group BV 11/24	213	MARKS & SPENCER PLC 12/23 GBP07940	100
TUI AG 10/21	360	VALEO SA 01/24	210	Nokia OYJ 3/21	95
Picard Bondco SA 11/24	351	AIR FRANCE - KLM	206	ROLLS-ROYCE PLC 06/21	91
BBG00YVS6VX8 VERISURE MIDHOLDING AB 2/29	349	ZF EUROPE FINANCE BV	188	PPF TELECOM GROUP BV 5/24	89
United Group BV 7/22	342	Telecom Italia SpA 1/24	183	ACCOR SA 02/21	73
Cirsa Finance International Sarl 5/25	334	INTL CONSOLIDATED AIRLINES GRP ORD	179	GKN HOLDINGS PLC 09/22 GBP04640	57

Quelle: Indexanbieter, as at 29. Februar 2024

Aufgrund von Rundungen summieren sich die Zahlen möglicherweise nicht immer zu 100,00%.

Zusätzliche Information

Ein Glossar der Begriffe finden Sie unter etf.dws.com.

Die Wertentwicklung des ETF ist auf NIW-Basis angegeben, nach Abzug der Gebühren und Kosten für die Indexnachbildung. Die Wertentwicklung des Index wird auf Basis der Gesamttrendite berechnet. Die Volatilität wird seit der Auflegung der Anteilsklasse berechnet.

Haftungsausschluss

Dieses Dokument ist als Marketingmitteilung gedacht und begründet keine rechtsverbindlichen Verpflichtungen seitens der DWS Group GmbH & Co. KGaA und/oder mit ihr verbundener Unternehmen (DWS). Dieses Dokument stellt keine Anlageberatung dar. Ohne Einschränkung stellt dieses Dokument kein Angebot, keine Aufforderung zur Abgabe eines Angebots und keine Empfehlung zum Abschluss einer Transaktion dar. Bevor ein Anleger eine Anlageentscheidung trifft, muss er mit oder ohne Unterstützung eines Anlageberaters abwägen, ob die von der DWS beschriebenen oder zur Verfügung gestellten Anlagen und Strategien im Hinblick auf seine besonderen Anlagebedürfnisse, Ziele und finanziellen Verhältnisse angemessen sind.

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen stammen aus Quellen, die wir für zuverlässig und aktuell halten. Die Richtigkeit oder Vollständigkeit der Quellen kann jedoch nicht garantiert werden. Gemäß den Angaben im Verkaufsprospekt unterliegt der Vertrieb der in diesem Dokument genannten Produkte den Beschränkungen der jeweiligen Rechtsordnungen. Dieses Dokument und die darin enthaltenen Informationen dürfen nur in Rechtsordnungen verteilt und veröffentlicht werden, in denen eine solche Verteilung und Veröffentlichung nach dem in diesen Rechtsordnungen geltenden Recht zulässig ist. Die direkte oder indirekte Verbreitung dieses Dokuments ist in den USA sowie an oder für Rechnung von US-Personen und Personen mit Wohnsitz in den USA verboten.

Xtrackers II ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften und wurde als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und getrennter Haftung zwischen den einzelnen Teilfonds gegründet.

Die Anleger müssen Anteile an Xtrackers OGAW-ETFs auf einem Sekundärmarkt mit Hilfe eines Vermittlers (z. B. eines Börsenmaklers) kaufen und in der Regel auch wieder verkaufen, wofür Gebühren anfallen können. Darüber hinaus können Anleger beim Kauf von Anteilen mehr als den aktuellen Nettoinventarwert zahlen und beim Verkauf weniger als den aktuellen Nettoinventarwert erhalten. Bevor sie eine Anlageentscheidung treffen, sollten Anleger die Risikofaktoren im Prospekt und im Basisinformationsblatt lesen.

Die steuerliche Behandlung der Xtrackers OGAW-ETFs hängt von den individuellen Umständen des jeweiligen Anlegers ab. Xtrackers II wurde im Großherzogtum Luxemburg gegründet, ist im Luxemburger Handels- und Gesellschaftsregister unter der Nummer B-124.284 eingetragen und hat seinen eingetragenen Sitz in 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburg. Die DWS Investment S.A. ist die Verwaltungsgesellschaft von Xtrackers II. Die Investmentgesellschaft kann beschließen, die für den Vertrieb dieses Fonds getroffenen Vereinbarungen zu kündigen.

Vollständige Informationen über den Fonds, einschließlich aller Risiken und Kosten, finden Sie im jeweils aktuellen Verkaufsprospekt. Diese stellen zusammen mit dem jeweiligen Basisinformationsblatt die einzigen verbindlichen Verkaufsunterlagen für den Fonds dar. Der Anleger erhält diese Unterlagen zusammen mit den aufsichtsrechtlichen Informationen sowie den aktuellen Gründungsunterlagen des Fonds in deutscher Sprache bei der DWS Investment GmbH, Mainzer Landstraße 11-17, 60329 Frankfurt am Main oder in englischer Sprache bei der DWS Investment S.A., 2, Boulevard Konrad Adenauer, L-1115 Luxemburg, in gedruckter Form kostenlos oder in den jeweiligen Sprachen bei Deutschland: <https://etf.dws.com/de-de/> Österreich: <https://etf.dws.com/de-at/> Belgien: <https://etf.dws.com/en-be/> Frankreich: <https://etf.dws.com/fr-fr/> Italien: <https://etf.dws.com/it-it/> Luxemburg: <https://etf.dws.com/en-lu/> Spanien: <https://etf.dws.com/es-es/> Niederlande: <https://etf.dws.com/nl-nl/> Schweden: <https://etf.dws.com/sv-se/> und UK/Irland: <https://etf.dws.com/en-gb/>. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte finden Sie auf www.etf.dws.com unter "Über uns - Wie kann ich mich beschweren?". **VERGANGENE LEISTUNGEN SIND KEINE GARANTIE FÜR ZUKÜNFTIGE ERGEBNISSE.**

© 2024 DWS International GmbH, gegebenenfalls handelnd durch ihre Niederlassungen

Index Haftungsausschluss

Der Index und die darin enthaltenen Handelsmarken sind das geistige Eigentum von Markit Indices Limited und/oder ihren Lizenzgebern („Markit“) und werden unter der Lizenz von Markit verwendet. Der Fonds wird von Markit weder gesponsert noch empfohlen, verkauft oder beworben. Markit übernimmt hierfür keine Haftung und gibt weder ausdrücklich noch stillschweigend irgendeine Zusicherung oder Erklärung hinsichtlich der Richtigkeit bzw. Eignung für einen bestimmten Zweck oder der aus der Nutzung des Index erzielten Ergebnisse ab. Der vollständige Haftungsausschluss ist im Fondsprospekt enthalten.