DWS Xtrackers

Dieses Informationsblatt entspricht dem Stand vom 29. Februar 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 Unternehme

Fondsinformationen	
ISIN	LU0321462870
Währung der Anteilsklasse	EUR
Fondswährung	EUR
Auflegungstermin des Fonds	07. November 2007
Gesellschaftssitz	Luxemburg
Portfoliomethode	Substitute Basket + Swap
Portfoliounterverwalter	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 31,54
Fondsvermögen	EUR 31,24 Mio.
Im Umlauf befindliche Anteile insgesamt	990.391,00
Index Name	Markit iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX

[1] Weitere Informationen / Glossar finden Sie hier.

Eigenschaften vom Index

Der Markit 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.

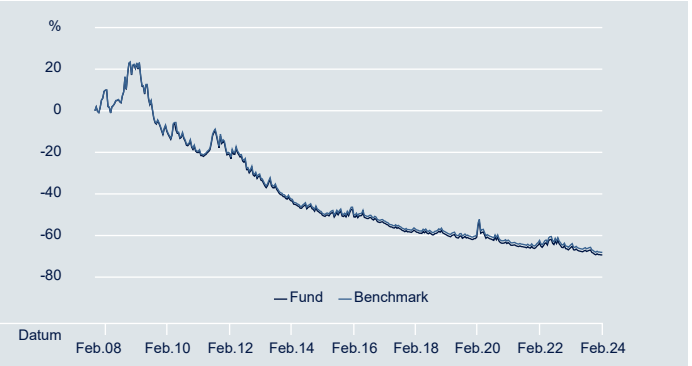
Die Performance dieses Index wird von drei Faktoren bestimmt: abzüglich der laufenden Rendite des CDS (Carry), abzüglich der Änderung der CDS-Preise und der laufenden Rendite aus der Finanzierungs-Komponente (Euro short term rate-Satz).
Weitere Informationen zum Index und zur allgemeinen Methodik hinter den iTraxx-Indizes sind auf der Markit 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.

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

Historische Entwicklung



Quelle: DWS, Indexanbieter

Angaben zur kumulierten Wertentwicklung						
	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	Annualisierte Volatilität
Anteilsklassen	-0,92%	-2,94%	-5,26%	-8,41%	-16,14%	8,30%
Index	-0,90%	-2,88%	-5,15%	-8,19%	-15,54%	8,24%
Tracking-Abweichung	-0,02%	-0,06%	-0,11%	-0,22%	-0,60%	-
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%	-0,11%
Index	-9,30%	-4,56%	-6,78%	2,26%	-10,68%	-0,07%
Tracking-Abweichung	-0,22%	-0,23%	-0,23%	-0,24%	-0,21%	-0,04%
Tracking Error	0,19%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%

Angaben zur rollierenden Wertentwicklung										
	2/14 - 2/15	2/15 - 2/16	2/16 - 2/17	2/17 - 2/18	2/18 - 2/19	2/19 - 2/20	2/20 - 2/21	2/21 - 2/22	2/22 - 2/23	2/23 - 2/24	Seit Auflage
Anteilsklassen	-11,78%	2,32%	-9,71%	-8,72%	-4,55%	-1,25%	-7,91%	-3,68%	-4,94%	-8,41%	-6,98%
Index	-11,57%	2,56%	-9,48%	-8,50%	-4,32%	-1,01%	-7,69%	-3,45%	-4,72%	-8,19%	-6,76%
Tracking-Abweichung	-0,21%	-0,25%	-0,22%	-0,22%	-0,23%	-0,24%	-0,22%	-0,23%	-0,22%	-0,22%	-0,08%
Tracking Error	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,04%	0,19%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,54%

DWS Xtrackers

Dieses Informationsblatt entspricht dem Stand vom 29. Februar 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	ITRXSX5I
Indextyp	Brutto-Gesamtrendite
Index Basiswährung	EUR
Anzahl Aktien im Index	75
Häufigkeit der Index-Neugewichtung	Halbjährlich
Aktueller Spread (in bps)	416

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
ATOS SE 11/28 AV387914	5.408
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 1.750% 2025-01-14	1.458
Intrum Justitia AB 7/24	1.453
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 5/24	1.161
Numericable Group SA 5/24	1.047
ADLER Real Estate AG 12/21	827
Boparan Finance PLC	764
Altice Finco S.A.	541
EG GLOBAL FINANCE PLC SR SECURED REGS 10/25 6.25	539
BBG00YZ4R632 INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 1/26	527
3.25 Bellis26Nts -S	524
Stonegate Pub Company Financing PLC	514
Iceland Bondco PLC	511
Grifols SA 5/25	509
MOTION BONDCO DAC SR SECURED REGS 11/27 4.5	495
Loxam SAS 4/25	473
METRO AG 10/21 EUR33459	465
VERTICAL HOLDCO GMBH 7/28	461
TUI AG 10/21	450
Monitchem Holdco 3 S.A.	450
INEOS Group Holdings SA 8/24	440
United Group BV 7/22	438
CITYCON TREASURY BV 09/26 EUR52987	425
Picard Bondco SA 11/24	405
Novafives S.A.S. 6/25	403

Referenzwert	Spread in BP
BBG012V24F52 ILIAD HOLDING SAS SR SECURED REGS 10/28 5.625 10/28	389
BBG00YVS6VX8 VERISURE MIDHOLDING AB 2/29	378
CW Sr Fin Ltd	353
Cirsa Finance International Sarl 5/25	352
Ziggo Bond Finance BV 1/25	350
BBG012R3Z7K2 KAIXO BONDCO TELECOM SAU 9/29	338
BBG014LLWV97 WEBUILD SPA 7/26	314
BBG0152D25Y5 ALLWYN ENTERTAINMENT FIN 02/28 1 2/28	313
CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH	305
VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	299
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC	286
UPC Holding B.V.	276
EP INFRASTRUCTURE AS 1.659% 2024-04-26	271
OI European Group BV 11/24	257
3.15 TECHNIP 23	246
VOLVO CAR AB	245
Stena Aktiebolag	244
AIR FRANCE - KLM	238
PIRELLI/FORVIA/TESLA	237
VALEO SA 01/24	233
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GRP ORD	224
BBG0100PWW51 NEXI SPA 4/26	221
ZF EUROPE FINANCE BV	219
Matterhorn Telecom Holding SA 5/23	217
Telecom Italia SpA 1/24	215

Referenzwert	Spread in BP
Hapag-Lloyd AG 7/24	215
Saipem Finance International BV 9/23	203
Constellium NV 2/26	197
RENAULT 3/21	186
SCHAEFFLER AG 03/24 AX751866	185
Premier Foods Finance PLC	182
ThyssenKrupp AG 2/25	172
DUFRY ONE BV	171
AUTOSTRADE SPA 02/25 EUR54744	153
Nidda Healthcare Holding GmbH 9/24	150
Cleopatra Finance Ltd 2/23	147
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 0.25% 06/09/2024 9/24	139
BBG00NSG83Y1	135
ERICSSON LM 05/22	125
Crown European Holdings SA 5/25	119
Cellnex Telecom SA 7/22	119
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE ORD SHS	117
Rexel SA 6/25	116
Nokia OYJ 3/21	112
MARKS & SPENCER PLC 12/23 GBP07940	109
Elis 4/24	105
ROLLS-ROYCE PLC 06/21	105
PPF TELECOM GROUP BV 5/24	92
ACCOR SA 02/21	85
GKN HOLDINGS PLC 09/22 GBP04640	63

Quelle: Indexanbieter; as at 31. Januar 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 Gesamtrendite 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.