

Dieses Informationsblatt entspricht dem Stand vom 31. August 2023, 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 von 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](http://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 Aktienmärkten 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 <sup>1</sup>	0,24% p.a.
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Aktive Swap-Kontrahenten	Deutsche Bank AG
Nettoinventarwert (NAV)	EUR 33,30
Fondsvermögen	EUR 52,39 Mio.
Im Umlauf befindliche Anteile insgesamt	1,57 Mio.
Index Name	Markt iTraxx® Crossover 5- year Short TOTAL RETURN INDEX

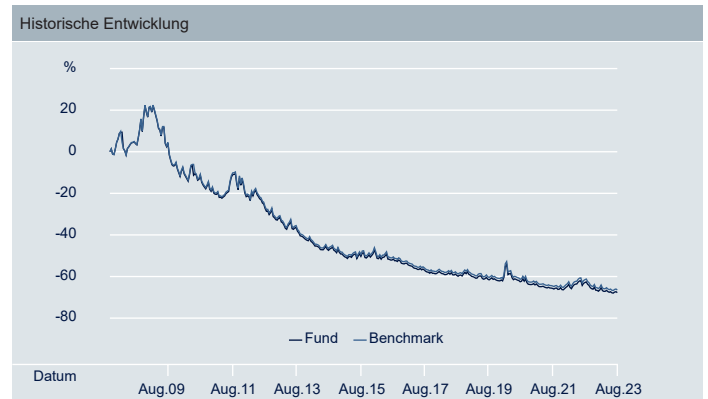
<sup>1</sup> Weitere Informationen / Glossar finden Sie hier.

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	0,58%	-1,81%	-3,32%	-13,08%	-14,59%	8,39%
Index	0,60%	-1,75%	-3,20%	-12,88%	-13,98%	8,32%
Tracking-Abweichung	-0,02%	-0,06%	-0,12%	-0,20%	-0,61%	-
Tracking Error	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	-

Angaben zur Wertentwicklung im Kalenderjahr						
	2018	2019	2020	2021	2022	YTD
Anteilsklassen	1,12%	-9,52%	-4,79%	-7,01%	2,02%	-6,05%
Index	1,37%	-9,30%	-4,56%	-6,78%	2,26%	-5,90%
Tracking-Abweichung	-0,24%	-0,22%	-0,23%	-0,23%	-0,24%	-0,15%
Tracking Error	0,04%	0,19%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%

Angaben zur rollierenden Wertentwicklung												
	8/13 - 8/14	8/14 - 8/15	8/15 - 8/16	8/16 - 8/17	8/17 - 8/18	8/18 - 8/19	8/19 - 8/20	8/20 - 8/21	8/21 - 8/22	8/22 - 8/23	Seit Auflage	
Anteilsklassen	-16,48%	-5,88%	-3,83%	-9,96%	-5,26%	-5,31%	-2,54%	-9,08%	8,08%	-13,08%	-6,88%	
Index	-16,28%	-5,66%	-3,60%	-9,74%	-5,04%	-5,07%	-2,32%	-8,86%	8,34%	-12,88%	-6,65%	
Tracking-Abweichung	-0,21%	-0,23%	-0,24%	-0,22%	-0,22%	-0,24%	-0,23%	-0,22%	-0,26%	-0,20%	-0,08%	
Tracking Error	0,96%	0,01%	0,01%	0,01%	0,03%	0,20%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,55%	



Quelle: DWS, Indexanbieter

Dieses Informationsblatt entspricht dem Stand vom 31. August 2023, 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-Gesamtrendite
Index Basiswährung	EUR
Anzahl Aktien im Index	75
Häufigkeit der Index-Neugewichtung	Halbjährlich
Aktueller Spread (in bps)	1.652

Quelle: Indexanbieter

### Mehr Informationen zu Xtrackers

DWS International GmbH | Xtrackers Info: [etf.Xtrackers.com](mailto:etf.Xtrackers.com)  
 Team E-Mail: [xtrackers@dws.com](mailto: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
Casino Guichard Perrachon SA 6/22	94.620	UPC Holding B.V.	452	ThyssenKrupp AG 2/25	212
Boparan Finance PLC	1.674	VERTICAL HOLDCO GMBH 7/28	445	SCHAEFFLER AG 03/24 AX751866	212
ADLER Real Estate AG 12/21	1.510	INEOS Group Holdings SA 8/24	437	3.15 TECHNIP 23	211
Altice Finco S.A.	1.244	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	426	BBG0100PWW51 NEXI SPA 4/26	208
Intrum Justitia AB 7/24	1.168	BBG012V24F52 ILIAD HOLDING SAS SR SECURED REGS 10/28 5.625 10/28	413	LADBROKES PLC	187
Numericable Group SA 5/24	1.126	Grifols SA 5/25	412	ROLLS-ROYCE PLC 06/21	185
TUI AG 10/21	688	AIR FRANCE - KLM	411	Cellnex Telecom SA 7/22	177
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 5/24	688	Saipem Finance International BV 9/23	400	AUTOSTRADE SPA 02/25 EUR54744	172
Nidda Healthcare Holding GmbH 9/24	648	BBG012R3Z7K2 KAIKO BONDCO TELECOM SAU 9/29	384	Cleopatra Finance Ltd 2/23	159
United Group BV 7/22	648	ZF EUROPE FINANCE BV	353	Elis 4/24	157
3.25 Bellis26Nts -S	641	Stena Aktiebolag	352	Rexel SA 6/25	156
METRO AG 10/21 EUR33459	617	Cirsa Finance International Sarl 5/25	342	MARKS & SPENCER PLC 12/23 GBP07940	153
Iceland Bondco PLC	602	INTL CONSOLIDATED AIRLINES GRP ORD	323	Nokia OYJ 3/21	148
Novafives S.A.S. 6/25	594	Telecom Italia SpA 1/24	309	Crown European Holdings SA 5/25	148
Loxam SAS 4/25	578	Faurecia 6/23	287	ERICSSON LM 05/22	146
Monitchem Holdco 3 S.A.	569	Matterhorn Telecom Holding SA 5/23	275	K+S AG 7/24	145
Stonegate Pub Company Financing PLC	539	Constellium NV 2/26	260	Fresenius Finance BV 2/24	130
CW Sr Fin Ltd	539	OI European Group BV 11/24	258	Leonardo SpA 6/24	116
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC	523	Hapag-Lloyd AG 7/24	243	BBG00NSG83Y1	116
EG GLOBAL FINANCE PLC SR SECURED REGS 10/25 6.25	503	VOLVO CAR AB	243	ACCOR SA 02/21	111
BBG00YVS6VX8 VERISURE MIDHOLDING AB 2/29	497	VALEO SA 01/24	231	SYNGENTA FINANCE NV 11/21	99
Picard Bondco SA 11/24	483	RENAULT 3/21	226	PPF TELECOM GROUP BV 5/24	96
BBG00YZ4R632 INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 1/26	476	Premier Foods Finance PLC	226	GKN HOLDINGS PLC 09/22 GBP04640	93
Ziggo Bond Finance BV 1/25	467	DUFYR ONE BV	223	TEOLVOI	56
EP INFRASTRUCTURE AS 1.659% 2024-04-26	454	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 0.25% 06/09/2024 9/24	215	FCCAQU	37

Quelle: Indexanbieter, as at 31. Juli 2023  
 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](http://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

Bei dem vorliegenden Dokument handelt es sich um eine Werbemitteilung. Die in diesem Dokument enthaltenen Angaben stellen keine Anlageberatung oder Anlageempfehlung dar. Die vollständigen Angaben zum Teilfonds einschließlich der Risiken sind dem Verkaufsprospekt in der geltenden Fassung zu entnehmen. Dieser sowie das Basisinformationsblatt stellen die allein verbindlichen Verkaufsdokumente des Teilfonds dar. Anleger können diese Dokumente sowie Kopien der Satzung und die jeweiligen, zuletzt veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte bei der Zahl- und Informationsstelle, (DWS Investment GmbH, Mainzer Landstraße 11-17 – D-60329 Frankfurt am Main) kostenlos in Papierform und deutscher Sprache erhalten und unter [etf.dws.com](http://etf.dws.com) herunterladen. Alle Meinungsäußerungen geben die aktuelle Einschätzung der DWS International GmbH wieder, die sich ohne vorherige Ankündigung ändern können. Wie im jeweiligen Verkaufsprospekt erläutert, unterliegt der Vertrieb des oben genannten Teilfonds in bestimmten Rechtsordnungen Beschränkungen. So darf der hierin genannte Teilfonds weder innerhalb der USA, noch an oder für Rechnung von US-Personen oder in den USA ansässigen Personen zum Kauf angeboten oder an diese verkauft werden. Dieses Dokument und die in ihm enthaltenen Informationen dürfen nur in solchen Staaten verbreitet oder veröffentlicht werden, in denen dies nach den jeweils anwendbaren Rechtsvorschriften zulässig ist. Der direkte oder indirekte Vertrieb dieses Dokuments in den USA sowie dessen Übermittlung an oder für Rechnung von US-Personen oder an in den USA ansässige Personen, sind untersagt. Alle hier abgebildeten Kurse und Preise werden nur zu Informationszwecken zur Verfügung gestellt und dienen nicht als Indikator handelbarer Kurse / Preise. Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt nach der BVI (Bundesverband Investment und Asset Management) Methode, d.h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Individuelle Kosten wie beispielsweise Gebühren, Provisionen und andere Entgelte sind in der Darstellung nicht berücksichtigt und würden sich bei Berücksichtigung negativ auf die Wertentwicklung auswirken. Der in diesem Dokument genannte Teilfonds bildet die Wertentwicklung des in seinem Namen genannten Index ab. Der Index-Sponsor haftet nicht für Fehler in seinem Index und ist nicht verpflichtet, auf entsprechende Fehler aufmerksam zu machen. Der Index Name ist eine eingetragene Marke des Index Sponsor („Index Sponsor“) bzw. des Lizenzgeber („Lizenzgeber“). Der Index Sponsor bzw. Lizenzgeber des hier aufgeführten Index gibt keinerlei Zusicherungen oder Gewährleistungen in Bezug auf Ergebnisse, die durch die Nutzung ihres Index und/oder der Indexstände oder in anderer Hinsicht an einem bestimmten Tag erzielt wurden. Der Teilfonds kann aufgrund der Zusammensetzung bzw. der für die Fondsverwaltung verwendeten Techniken eine erhöhte Volatilität (Wertschwankung) aufweisen.

Xtrackers II ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) gemäß den anwendbaren Gesetzen und Vorschriften und als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und getrennter Haftung zwischen den Teilfonds strukturiert. Xtrackers II ist in Luxemburg unter der Registernummer RCS-Nr.: B-124.284 eingetragen und hat ihren eingetragenen Sitz in 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg. DWS Investment S.A. fungiert als Verwaltungsgesellschaft der Xtrackers II.  
 © DWS Investments UK Limited, 2023. Autorisiert und reguliert von der Financial Conduct Authority.

### 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.