

Dieses Informationsblatt entspricht dem Stand vom 28. April 2023, sofern nicht anders angegeben.

# Xtrackers II EUR Covered Bond Swap UCITS ETF 1C

ein Teilfonds von Xtrackers II

## Überblick

- Investition in EUR denominierte Covered Bonds
- Nur Anleihen mit Investment-Grade-Qualität

## Eigenschaften von Index

Der MARKIT IBOXX EUR LIQUID COVERED INDEX® zielt darauf ab, die Wertentwicklung des folgenden Markts abzubilden:

- auf EUR lautende gedeckte Anleihen
- Engagement über die gesamte Renditekurve hinweg (Mindestlaufzeit von 3 Jahren, Anleihen, die höchstens 2 Jahre alt sind)
- nur Investment-Grade-Anleihen
- in Umlauf befindliches Volumen von mindestens 1 Milliarde EUR pro Anleihe
- Emittentenobergrenze von 20 % und Emittenten mit Gewichtungen über 5 % dürfen nicht mehr als 20 % des Index ausmachen

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

Fonds Informationen	
ISIN	LU0820950128
Währung der Anteilsklasse	EUR
Fondswährung	EUR
Auflegungstermin des Fonds	27. November 2012
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 <sup>1</sup>	0,20% p.a.
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Aktive Swap-Kontrahenten	Deutsche Bank AG
Nettoinventarwert (NAV)	EUR 135,42
Fondsvermögen	EUR 2,19 Mio.
Im Umlauf befindliche Anteile insgesamt	16.193,00

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

## 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.
- Anleihen sind dem Kredit- und Zinsrisiko ausgesetzt. Es besteht das Risiko, dass der Anleiheemittent möglicherweise nicht in der Lage ist, Zinszahlungen zu leisten oder das Anleihekaptial zurückzuzahlen, sodass in Bezug auf Ihre Anlage ein Verlust entsteht. Ein Zinsanstieg führt gewöhnlich zu einem Wertverlust der Anleihe, was sich ebenfalls auf den Wert Ihrer Anlage auswirken kann.
- 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.

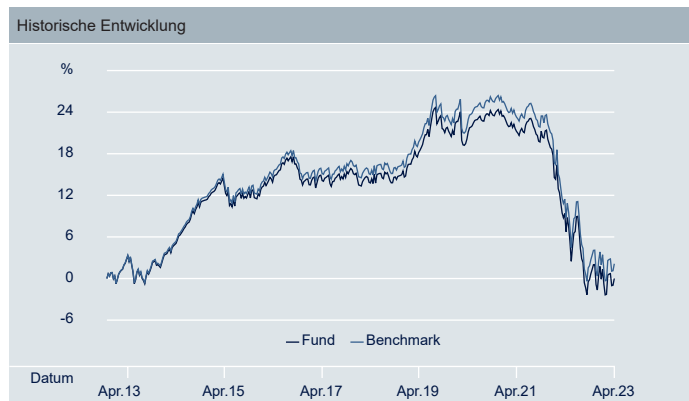
Notierungs- und Handelsinformationen			
Börse	Bloomberg Ticker	Reuters RIC	Handelswährung
XETRA	XLIQ.GY	XLIQ.DE	EUR

Angaben zur kumulierten Wertentwicklung						
	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	Annualisierte Volatilität
Anteilklassen	0,24%	-0,07%	0,61%	-7,52%	-17,44%	3,60%
Index	0,26%	-0,02%	0,72%	-7,33%	-16,93%	3,46%
Tracking-Abweichung	-0,02%	-0,05%	-0,11%	-0,19%	-0,51%	-
Tracking Error	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	-

Angaben zur Wertentwicklung im Kalenderjahr						
	2018	2019	2020	2021	2022	YTD
Anteilklassen	0,04%	4,68%	2,87%	-3,49%	-17,80%	1,70%
Index	0,25%	4,89%	3,08%	-3,29%	-17,63%	1,77%
Tracking-Abweichung	-0,21%	-0,21%	-0,21%	-0,19%	-0,17%	-0,07%
Tracking Error	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%

Angaben zur rollierenden Wertentwicklung												
	4/13 - 4/14	4/14 - 4/15	4/15 - 4/16	4/16 - 4/17	4/17 - 4/18	4/18 - 4/19	4/19 - 4/20	4/20 - 4/21	4/21 - 4/22	4/22 - 4/23	Seit Auflage	
Anteilklassen	1,91%	8,02%	0,56%	0,27%	-0,12%	3,43%	2,57%	0,14%	-10,85%	-7,52%	0,03%	
Index	2,12%	8,22%	0,76%	0,47%	0,09%	3,64%	2,77%	0,34%	-10,67%	-7,33%	0,23%	
Tracking-Abweichung	-	-	-	-	-	-0,21%	-0,21%	-0,20%	-0,18%	-0,19%	-	
Tracking Error	-	-	-	-	-	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	-	

Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.



Quelle: DWS, Indexanbieter

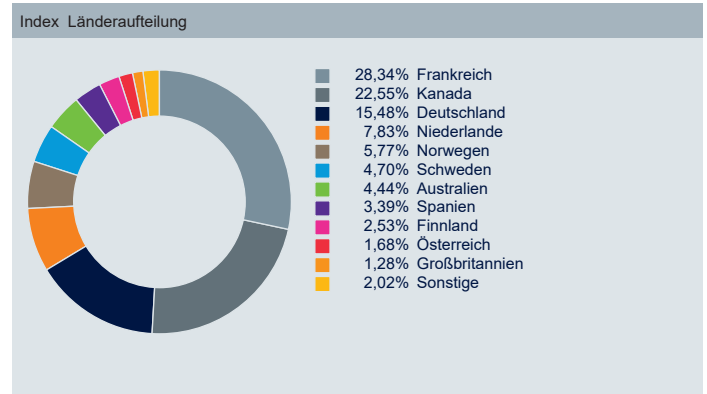
Die Berechnung des Tracking Error und der Tracking-Abweichung wird am 11. September 2017 infolge einer Änderung der Nachbildungsmethode (Wechsel von synthetischer zu direkter Nachbildung) zurückgesetzt.

Dieses Informationsblatt entspricht dem Stand vom 28. April 2023, sofern nicht anders angegeben.

Die 10 größten Index-Bestandteile		
Wertpapier	ISIN	Gewichtung
BBG014MGCCF4 BANK OF MONTREAL 1/27	XS2430951744	1,45%
BBG015RMSV50 CANADIAN IMP BANK 3/26	XS2454011839	1,37%
BBG016594SW9 TORONTO DOMINION BANK COVERED REGS 03/27 0.864 3/27	XS2461741212	1,37%
BBG019FQ4JM5 BANCO SANTANDER SA 27 2.375 9/27	ES0413900848	1,31%
BBG015W249Q5 BANK OF NOVA SCOTIA 3/26	XS2457002538	1,21%
BBG01F5R14B8 ING BANK NV COVERED REGS 02/33 3 2/33	XS2585966505	1,18%
BBG016120ND1 ROYAL BANK OF CANADA COVERED REGS 03/26 0.625 3/26	XS2460043743	1,11%
BBG019XNM052 CAISSE REFINANCE L HABIT COVERED REGS 04/28 2.75 4/28	FR001400D5T9	1,10%
BBG014LVJT95 ROYAL BANKOF CANADA 4/27	XS2436159847	1,05%
BBG01C94WG67 BANK OF NOVA SCOTIA 28 3.25 1/28	XS2576390459	1,05%

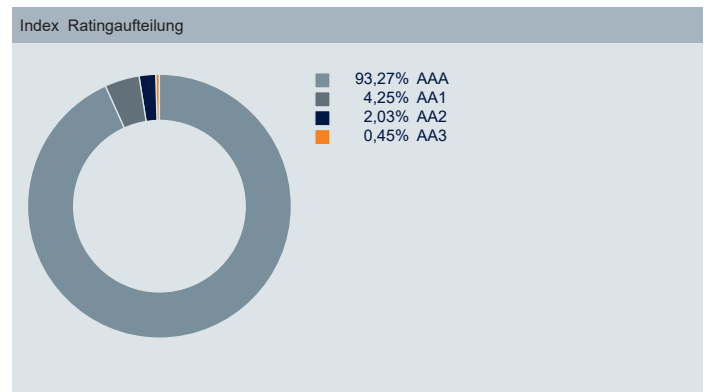
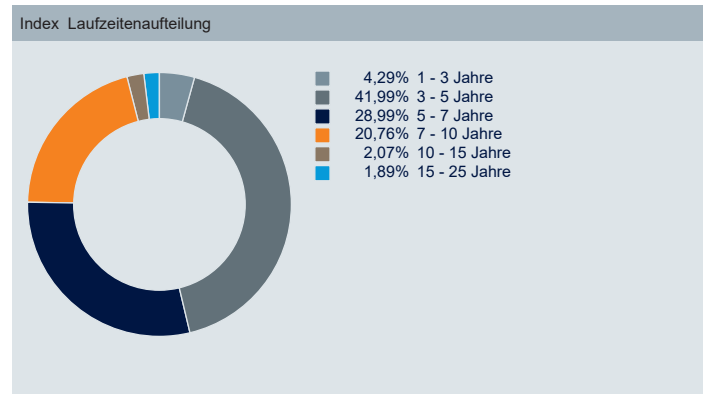
**MARKIT IBOXX EUR LIQUID COVERED INDEX®**

Quelle: Indexanbieter, as at 31. März 2023  
Aufgrund von Rundungen summieren sich die Zahlen möglicherweise nicht immer zu 100,00%.



Index Informationen	
Index Name	MARKIT IBOXX EUR LIQUID COVERED INDEX®
Index Provider	Markit Indices Limited
Bloomberg Symbol	IBXECVT
Indextyp	Brutto-Gesamttrendite
Index Basiswährung	EUR
Häufigkeit der Index-Neugewichtung	Monatlich
Kupon	1,51%
Effektive Duration	5,73
Geänderte Duration	5,62
Rückzahlungsrendite	3,27%

Quelle: Indexanbieter



**Mehr Informationen zu Xtrackers**

DWS  
Mainzer Landstrasse 11-17  
60329 Frankfurt am Main  
Hotline: +49 69 910 30549  
Fax: +49 69 910 41276

Info: Xtrackers.com  
E-Mail: Xtrackers@dws.com

**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 Gesamttrendite berechnet. Die Volatilität wird seit der Auflegung der Anteilsklasse berechnet.

**Haftungsausschluss**

Bei dem vorliegenden Dokument handelt es sich um eine Werbemittelung. 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 dem 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.