

Diese stellt ein Produktangebot dar und stellt keine Anlageberatung dar. Ausschließlich für professionelle Kunden.

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund

INVESTMENTMANAGER



Newton Investment Management: Newton ist bestrebt, seinen Kunden starke Ergebnisse mittels eines aktiven, mehrdimensionalen und aktiven Anlageansatzes zu liefern, welcher auf Newtons aktive Aktien-, Ertrags-, Absolute-Return- (einschließlich festverzinslicher), Multi-Asset-, thematische und nachhaltige Strategien angewendet wird.

ANLAGEZIEL

Eine Gesamtrendite mittels eines Multi-Asset-Ansatzes bei der Portfoliostrukturierung und Wertpapierauswahl zu erwirtschaften, die über einen Anlagehorizont von 3 bis 5 Jahren über einem Cash-Referenzwert (wie nachstehend beschrieben) mit einer Zielvolatilität von 10% liegt. Es gibt jedoch keine Garantie, dass dieses Ziel in diesem Zeitrahmen oder überhaupt erreicht werden kann.

BENCHMARK

Der Fonds verwendet den ICE BofA US 3-Month Treasury Bill Index (der „Cash-Referenzwert“) als Zielwert, an dem die Performance des Fonds über einen gleitenden annualisierten Zeitraum von drei Jahren vor Abzug von Gebühren gemessen wird. Der Fonds wird aktiv gemanagt, was bedeutet, dass der Anlageverwalter unter Berücksichtigung des Anlageziels und der Anlagepolitik nach eigenem Ermessen über die Auswahl der Anlagen entscheiden kann.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN ZUM FONDS

Fondsvolumen in Mio. \$ 37,28
 Benchmark ICE BofA US 3-Month Treasury Bill Index
 Lipper-Sektor Alternative Multi Strategies
 Fondstyp ICVC
 Sitz des Fonds Irland
 Fondsmanager Dimitri Curtil / Ryan Arita / James H Stavena / Torrey Zaches
 Basiswährung USD
 Verfügbare Währungen USD, GBP, EUR, CHF
 Auflegung des Fonds 18 Nov 2021
 Investment Vehikel Name BNY Mellon Global Fund

DETAILS ZUR ANTEILSKLASSE USD W (ACC.)

Auflegung 18 Nov 2021
 Mindestanlage \$ 15.000,000
 Max. Ausgabeaufschlag 5,00%
 Verwaltungsvergütung p.a. 0,55%
 ISIN IE000SRGUWK2
 WKN A3C3DF
 Zugelassen zum Vertrieb in: AT, BE, CH, CL, DE, DK, ES, FI, FR, GB, IE, IT, LU, NL, NO, PE, SE, SG

Anleger sollten sich auf das KIID/PRIIPs-Dokument beziehen, um eine Zusammenfassung der Gebühren zu erhalten. Die Gebühren decken die Kosten für den Betrieb des Teilfonds, einschliesslich der Kosten für Marketing und Verkauf. Diese Gebühren reduzieren das potenzielle Wachstum Ihrer Investition.

Die laufenden Kosten basieren auf den vierteljährlich berechneten Kosten, es sein denn, die verfügbaren Daten über die Wertentwicklung umfassen weniger als den Zeitraum eines vollen Kalenderjahres. In diesem Fall werden die Kosten geschätzt. Die laufenden Kosten können sich von Jahr zu Jahr ändern. Darin enthalten sind keine Performance- und Transaktionsgebühren, mit Ausnahme der Ausgabeauf-/Rücknahmeabschläge, die der Teilfonds für den Kauf oder Verkauf von Anteilen an einem anderen Anlagefonds zahlt.

RATINGS



Morningstar Ratings © 2025 Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. Die Ratings werden am jeweils ersten Bankarbeitstag eines Monats zusammengestellt. Mit Wirkung zum 17. Juli 2024 wurde die Performance-Benchmark vom FTSE 3 Month US T Bill Index zum ICE BofA US 3-Month Treasury Bill Index geändert.

INVESTMENT OPPORTUNITY

Drei zugrunde liegende Strategien: Global Macro, Cross-Asset Trend und Equity Long/Short.

Sechs Anlageklassen: Aktien, Anleihen, Credit, Rohstoffe, Währungen und Volatilität.

Diversifizierte Positionen: bis zu 1.000 Positionen, die etwa 2.000 globale Mid- und Large-Cap-Aktien, 23 Aktienindex-Futures, 24 Rohstoff-Futures, 18 globale Staatsanleihen-Futures, 4 kurzfristige Zinsmärkte, 4 Credit-Indexmärkte, 24 Industrie- und Schwellenländerwährungen sowie Volatilitätsindex-Futures umfassen können.

Flexible Implementierung: Long- oder Short-, marktneutrale oder direktionale sowie Long-Short-Spread-Positionen.

Frequenz: tägliche Neubewertung, Handel nach Bedarf und Maximierung nach Bedarf um Marktverschiebungen zu nutzen

HINWEISE ZUM ANLAGEZIEL UND ZUR DARSTELLUNG DER WERTENTWICKLUNG

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der Wert von Investitionen kann fallen. Anleger erhalten den investierten Betrag möglicherweise nicht zurück. Die Erträge aus Kapitalanlagen können variieren und sind nicht garantiert. Die Rendite Ihrer Investition kann sich aufgrund von Währungsschwankungen erhöhen oder verringern, wenn Ihre Investition in einer anderen Währung als der in der Berechnung der Wertentwicklung in der Vergangenheit verwendeten Währung getätigt wird.

KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG ÜBER 3 JAHRE (%)



PERFORMANCE-RÜCKBLICK (%)

	12 Monate bis Ende				Annualisiert			Seit Auflegung
	1 Monat	3 Monate	Seit Jahresbeginn	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	5 Jahre	
USD W (Acc.)	2,09	6,68	6,68	5,51	10,95	9,67	-	21,18
Benchmark	0,33	1,02	1,02	4,97	5,10	4,23	2,55	13,30
Euro W (Acc.) (hedged)	1,96	6,29	6,29	3,94	9,26	7,82	-	14,72
Benchmark	0,33	1,02	1,02	4,97	5,10	4,23	2,55	13,30

	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Fonds	-	-	-	-	-	-	-	-5,68	11,27	9,33
Benchmark	0,05	0,33	0,85	1,88	2,28	0,67	0,05	1,46	5,01	5,25

Quelle: Lipper. Die Fondsp performance dieser Anteilsklasse wird als Gesamtrendite berechnet, basierend auf dem Nettoinventarwert, einschließlich Gebühren, aber ohne Anfangskosten, und den reinvestierten Erträgen vor Steuern, ausgedrückt in der Währung der Anteilsklasse.

RISIKOALLOKATION NACH ASSETKLASSEN UND STRATEGIE (AKTUELLER MONAT)

	Global Macro (%)	Cross-Asset Trend (%)	Equity Long/Short (%)	Commodity Long/Short	Total (%)
Aktien global	1,29	0,70			1,99
Global Bonds	0,31	0,50			0,81
Rohstoffe				2,20	2,20
Credit Spreads	0,00				0,00
Currencies (G10)	0,66	0,21			0,87
Currencies (EM)	1,39	0,08			1,47
Short-Term IR	0,00	0,08			0,08
Volatility	0,00				0,00
Securities Aktien			3,65		3,65
Summe	3,65	1,58	3,65	2,20	11,07
Prozentsatz	32,95	14,23	32,95	19,87	100,00

RETURN_ATTRIBUTION_BY_ASSET_CLASS_AND_STRATEGY_(YTD)

	Global Macro (%)	Cross-Asset Trend (%)	Equity Long/Short (%)	Commodity Long/Short	Cash (%)	Total (%)
Aktien global	-0,94	1,19				0,25
Global Bonds	-1,41	0,12				-1,29
Rohstoffe				-0,21		-0,21
Credit Spreads	-0,01					-0,01
Currencies (G10)	0,15	-0,71				-0,57
Currencies (EM)	0,92	-0,05				0,87
Short-Term IR		-0,16				-0,16
Volatility	-0,09					-0,09
Low Volatility			6,35			6,35
Momentum			-0,29			-0,29
Quality			-3,82			-3,82
Value			4,73			4,73
Liquidität					1,09	1,09
Summe	-1,41	0,38	6,97	-0,21	1,09	6,84

TOP 5 BEITRÄGE (YTD)

	Gewinne (%)
UK 3M	0,4
US S&P 500	0,4
Norway 3M	0,4
Brazil 3M	0,3
Euro 10 Yr (Bund)	0,3

SCHLECHTESTE 5 BEITRÄGE (YTD)

	Verluste (%)
Sweden Stockholm OMX	-0,5
Japan 10Yr (JGB)	-0,5
Japan 3M	-0,4
Nikkei 225	-0,4
Germany DAX	-0,4

RISIKO DER GRÖßTEN POSITIONEN (AKTUELLER MONAT)

	Ø Risikoallokation (%)	Art der Position
Brazil 3M	1,04	Long
Schweiz 3M	0,96	Short
Kanadisch 10Yr	0,75	Short
France CAC 40	0,47	Short
Chile 3M	0,40	Short
Colombian Peso 3M NDF	0,39	Long
South Africa FTSE/JSE Top 40	0,37	Short
Canada 3M	0,35	Short
Australien	0,30	Long
US IG CDS	0,07	Short

FONDSSTATISTIK 3 JAHRE

Jensen Alpha	0,35
Beta	-8,03
Korrelation zum Referenzindex	-0,18
Information Ratio p.a.	0,66
Sharpe Ratio p. a.	0,65
Tracking Error p. a.	7,76
R ²	0,03
Standardabweichung p.a.	7,69
Maximaler Drawdown	-6,55
VaR (95%, unter normalen Bedingungen)	-2,90

Quelle: BNY Mellon Investment Management EMEA Limited

