

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund

INVESTMENTMANAGER



Newton Investment Management: Newton ist bestrebt, seinen Kunden starke Ergebnisse zu liefern, indem es einen aktiven, mehrdimensionalen und engagierten Anlageansatz verfolgt, der auf seine aktiven Aktien-, Ertrags-, Absolute-Return-Strategien (einschließlich Anleihen), Multi-Asset- und thematische Strategien sowie Strategien mit Nachhaltigkeitsmerkmalen angewendet wird.

ANLAGEZIEL

Erzielung einer Gesamtrendite, die über einem Anlagehorizont von 3-5 Jahren über einer Cash-Benchmark liegt, mit einer Zielvolatilität von 10 % durch einen alternativen Multi-Strategie-Ansatz über vier zugrunde liegende Strategien. Jedoch keine Garantie, dass dies über diesen oder einen anderen Zeitraum erreicht wird.

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.	\$ 35,62
Benchmark	ICE BofA US 3-Month Treasury Bill Index
Lipper-Sektor	Alternative Multi Strategies
Fondstyp	ICVC
Sitz des Fonds	Irland
Fondsmanager	James Stavena/ Torrey Zaches/ Ryan Arita
Basiswährung	USD
Verfügbare Währungen	USD, GBP, EUR, CHF
Auflegung des Fonds	18 Nov 2021
Investment Vehikel Name	BNY Mellon Global Funds, plc

DETAILS ZUR ANTEILSKLASSE USD W (ACC.)

Auflegung	18 Nov 2021
Mindesteinanlage	\$ 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

Kosten, die beim Kauf, Halten, Umtausch oder Verkauf von Anlagen anfallen, wirken sich auf die Rendite aus. Die Kosten können sich aufgrund von Währungs- und Wechselkursschwankungen erhöhen oder verringern.

HANDEL

An jedem Geschäftstag zwischen 9.00 Uhr und 17.00 Uhr.
Bewertungszeitpunkt: 22.00 Uhr (Dublin Zeit).
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.

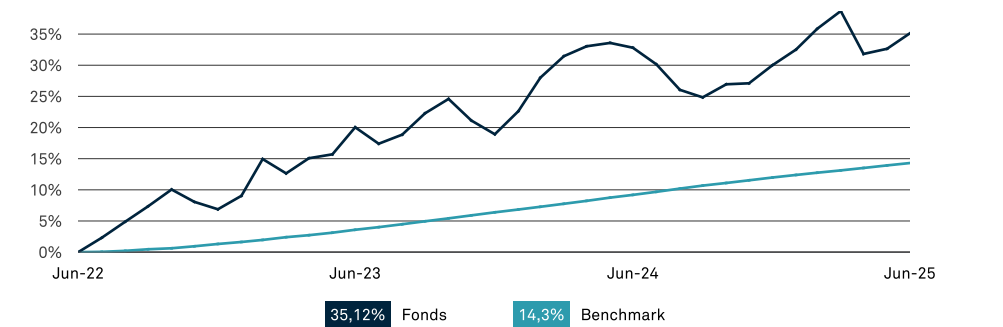
INVESTMENT OPPORTUNITY

Drei zugrunde liegende Strategien: Global Macro, Cross-Asset Trend und Equity Long/Short.
Sechs Anlageklassen: Aktien, Anleihen, Kredite, Rohstoffe, Währungen und Volatilität.
Diversifiziert: bis zu 1.000 Positionen, die etwa 1.500 globale Aktien, 23 Aktienindex-Futures, 24 Rohstoff-Futures, 9 globale Futures auf Staatsanleihen, 4 kurzfristige Zinsmärkte, 4 Kreditindexmärkte, 24 Industrie- und Schwellenländerwährungen sowie Volatilitätsengagements umfassen können.
Flexible Implementierung: Long- oder Short-, marktneutrale oder directionale sowie Long-Short-Spread-Positionen.
Häufigkeit: Tägliche Überprüfung der Chancen, Handeln bei Bedarf und Nutzung von Alpha-Möglichkeiten zur Ausnutzung von Marktverschiebungen.

HINWEISE ZUM ANLAGEZIEL UND ZUR DARSTELLUNG DER WERTENTWICKLUNG

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der Wert von Anlagen und die erzielten Erträge können sowohl fallen als auch steigen, und Anleger erhalten möglicherweise nicht den ursprünglich investierten Betrag zurück.
Bitte lesen Sie den Prospekt, das KID und andere Fondsdokumente, um eine vollständige Liste der Risiken zu erhalten und bevor Sie Anlageentscheidungen treffen. Die Dokumente sind in englischer Sprache und in ausgewählten Landessprachen verfügbar, in denen der Fonds registriert ist. Gehen Sie zu bny.com/investments.
Die Renditen können aufgrund von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG ÜBER 3 JAHRE (%)



PERFORMANCE-RÜCKBLICK (%)

					Annualisiert			Seit Auflegung		
	1 Monat	3 Monate	Seit Jahres- beginn	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	5 Jahre			
USD W (Acc.)	1,86	-2,58	3,93	1,73	6,08	10,54	-	18,05		
Benchmark	0,33	1,04	2,07	4,68	5,03	4,55	2,76	14,47		
Euro W (Acc.) (hedged)	1,68	-3,23	2,85	-0,11	4,39	8,58	-	11,01		
Benchmark	0,33	1,04	2,07	4,68	5,03	4,55	2,76	14,47		
	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 Fondsperformance 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	0,91	0,58			1,49
Global Bonds	0,24	0,06			0,30
Rohstoffe				3,14	3,14
Credit Spreads	0,00				0,00
Currencies (G10)	0,44	0,41			0,85
Currencies (EM)	1,38	0,17			1,55
Short-Term IR		0,05			0,05
Volatilität	0,00				0,00
Securities Aktien			3,26		3,26
Summe	2,97	1,27	3,26	3,14	10,64
Prozentsatz	27,94	11,94	30,64	29,48	100,00

ERTRAGSATTRIBUTION NACH ASSETKLASSEN UND STRATEGIE (YTD)

	Global Macro (%)	Cross-Asset Trend (%)	Equity Long/ Short (%)	Commo- dity Long/ Short	Cash (%)	Total (%)
Aktien global	-2,92	-0,65				-3.56
Global Bonds	-1,00	-0,18				-1.18
Rohstoffe				2,57		2.57
Credit Spreads	-0,02					-0.02
Currencies (G10)	-0,68	-0,32				-1
Currencies (EM)	-0,17	0,10				-0.08
Short-Term IR		-0,36				-0.36
Volatilität	-0,10					-0.1
Low Volatility			3,71			3.71
Momentum			2,94			2.94
Quality			-4,81			-4.81
Value			3,92			3.92
Liquidität					2,20	2.2
Summe	-4,89	-1,41	5,76	2,57	2,20	4.23

TOP 5 BEITRÄGE (YTD)

	Gewinne (%)
Commodity CS Dynamic	1,5
Commodity IC	1,4
UK 3M	1,1
Brazil 3M	1,0
Mexiko 3M	0,9

SCHLECHTESTE 5 BEITRÄGE (YTD)

	Verluste (%)
Schweiz 3M	-1,0
Czech 3M	-0,9
Japan TOPIX	-0,9
Sweden Stockholm OMX	-0,8
Japan 3M	-0,8

RISIKO DER GRÖßTEN POSITIONEN
(AKTUELLER MONAT)

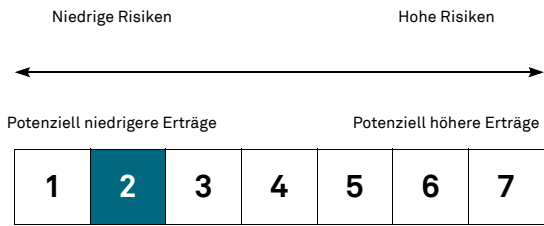
	Ø Risikoal- lokation (%)	Art der Po- sition
Brazil 3M	1,22	Long
EURO Stoxx	1,10	Long
Mexiko 3M	1,07	Long
Korea 3M	0,99	Short
Mini Ibovespa	0,99	Short
Japan 3M	0,98	Short
UK 3M	0,87	Long
Malaysia 3M	0,81	Short
Schweiz 3M	0,75	Short
US S&P 500	0,72	Long

FONDSSTATISTIK 3 JAHRE

Jensen Alpha	0,41
Beta	-14,85
Korrelation zum Referenzindex	-0,31
Information Ratio p.a.	0,68
Sharpe Ratio p. a.	0,68
Tracking Error p. a.	8,17
R²	0,10
Standardabweichung p.a.	7,97
Maximaler Drawdown	-6,55
VaR (95%, unter normalen Bedingungen)	-2,97

Quelle: BNY Mellon Investment Management EMEA Limited

ZUSAMMENFASSENDE RISIKOINDIKATOR (SRI) - USD W (ACC.)



Der Summary Risk Indicator ist eine Zahl zwischen 1 und 7, die in allen PRIIPs Key Information Documents (PRIIPs KID) angezeigt wird, um Anlegern einen Vergleich der Risiko- und Ertragsprofile der Fonds zu ermöglichen. 1 ist die niedrigste und 7 die höchste.

Die Risikokategorie wurde auf der Grundlage historischer Performancedaten (oder indikativer Fondsperformance während der Aussetzung) berechnet und ist möglicherweise kein verlässlicher Indikator für das zukünftige Risikoprofil des Fonds. Es kann nicht garantiert werden, dass die Risikokategorie des Fonds festgelegt bleibt. Weitere Informationen finden Sie im PRIIPs-KID.]

AUSSCHÜTTUNGSPROGNOSE (STAND 31.MAI 2025)

Anteilsklasse	Rendite
USD W (Acc.)	2,89%

Die Ausschüttungsrendite spiegelt den Betrag wider, den ein Fonds in den nächsten zwölf Monaten voraussichtlich ausschütten wird, als Prozentsatz des Fondspreises zum angegebenen Zeitpunkt. Die Renditen werden auf Nettobasis ausgewiesen, enthalten keine Anfangskosten, und Anleger können der Ausschüttungssteuer unterliegen.

WICHTIGE KUNDENINFORMATION

Ausschließlich für professionelle Kunden. Die Investment Manager werden von BNY Mellon Investment Management EMEA Limited (BNYMIM EMEA), BNY Mellon Fund Managers Limited (BNYMFML), BNY Mellon Fund Management (Luxemburg) S.A. (BNY MFML) oder den daran angeschlossenen Fondsgesellschaften mit der Erbringung von Portfoliomanagement-Dienstleistungen für die Produkte und Services beauftragt, basierend auf Verträgen zwischen Kunden von BNYMIM EMEA, BNY MFML oder BNY Mellon Fonds. Die Portfoliopositionen können jederzeit ohne vorherige Ankündigung geändert werden. Die dargestellten Informationen dienen ausschließlich zur Veranschaulichung und dürfen nicht als Anlageempfehlung verstanden werden. Anrufe dürfen aufgezeichnet werden. Weitere Informationen dazu finden Sie in unserer Datenschutz-Richtlinie [bny.com/investments](#). Bei BNY, BNY Mellon und Bank of New York Mellon handelt es sich um die Markennamen der The Bank of New York Mellon Corporation und können verwendet werden, um auf das Unternehmen als Ganzes und/oder seine verschiedenen Tochtergesellschaften im Allgemeinen zu verweisen. Der Fonds ist ein Teilfonds der BNY Mellon Global Funds, plc, einer nach irischem Recht gegründeten offenen Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, beschränkter Haftung und Haftungstrennung zwischen den einzelnen Teilfonds. Das Unternehmen ist von der Zentralbank Irlands als OGAW-Fonds zugelassen. Die Verwaltungsgesellschaft ist BNY Mellon Fund Management (Luxemburg) S.A. (BNY MFML) und wird von der Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) beaufsichtigt. Eingetragener Firmensitz : 2-4 Rue Eugène Ruppert L-2453 Luxemburg. Informationen zu Anlegerrechten, einschließlich der Richtlinien zur Bearbeitung von Beschwerden und Rechtsbehelfsverfahren für Anleger, sind unter [bny.com/investments](#) verfügbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die für den Vertrieb eines oder mehrerer Teilfonds von BNYMGF in einem oder mehreren EU-Mitgliedstaaten getroffenen Vereinbarungen kündigen, und die Anteilinhaber werden in diesem Fall vorab benachrichtigt. In **Deutschland** ist der Verkaufsprospekt bei BNY Mellon Fund Management (Luxemburg) S.A. (BNY MFML), Zweigniederlassung Deutschland, MesseTurm, Friedrich-Ebert-Anlage 49, 60308 Frankfurt am Main, erhältlich. Herausgegeben in **Deutschland** von BNY Mellon Fund Management (Luxemburg) SA (BNY MFML), einer Aktiengesellschaft (Société Anonyme), die nach luxemburgischem Recht unter der Registrierungsnummer B28166 gegründet wurde . Eingetragener Firmensitz: 2-4 Rue Eugène Ruppert L-2453 Luxemburg. BNY MFML unterliegt der Aufsicht der Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). MIS0071-311225

Herausgegeben per 15/07/2025