


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. | \$ 42,45 |
| 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 |
| Mindesteinlage | \$ 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.

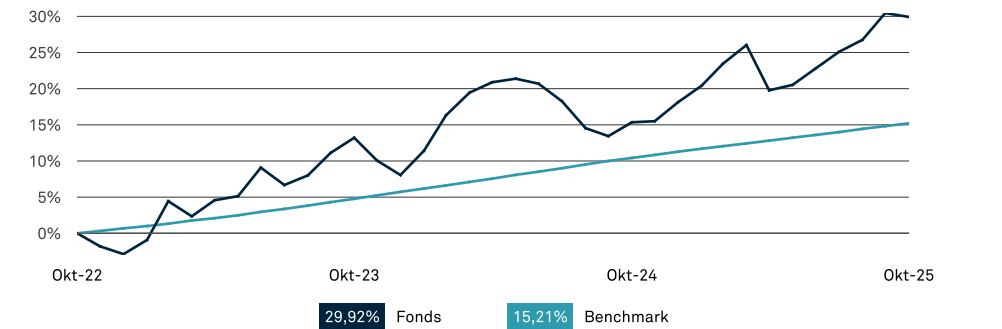
INVESTMENT OPPORTUNITY

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 (%)

| | 1 Monat | 3 Monate | Seit Jahresbeginn | 1 Jahr | Annualisiert | | | Seit Auflegung |
|------------------------|---------|----------|-------------------|--------|--------------|---------|---------|----------------|
| | | | | | 2 Jahre | 3 Jahre | 5 Jahre | |
| USD W (Acc.) | -0,41 | 3,87 | 9,97 | 12,63 | 7,12 | 9,11 | - | 24,92 |
| Benchmark | 0,35 | 1,08 | 3,53 | 4,34 | 4,86 | 4,83 | 3,04 | 16,11 |
| Euro W (Acc.) (hedged) | -0,63 | 3,24 | 7,93 | 10,28 | 5,23 | 7,14 | - | 16,49 |
| Benchmark | 0,35 | 1,08 | 3,53 | 4,34 | 4,86 | 4,83 | 3,04 | 16,11 |

| | 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 | 0,79 | 0,55 | | | 1,34 |
| Global Bonds | 0,19 | 0,26 | | | 0,46 |
| Rohstoffe | | | | 6,00 | 6,00 |
| Credit Spreads | 0,00 | | | | 0,00 |
| Currencies (G10) | 0,48 | 0,09 | | | 0,57 |
| Currencies (EM) | 1,29 | 0,12 | | | 1,41 |
| Short-Term IR | | 0,04 | | | 0,04 |
| Volatilität | 0,00 | | | | 0,00 |
| Securities Aktien | | | 3,07 | | 3,07 |
| Summe | 2,75 | 1,06 | 3,07 | 6,00 | 12,88 |
| Percentage of Total Risk | 21,37 | 8,23 | 23,83 | 46,57 | 100,00 |

ERTRAGSATTRIBUTION NACH ASSETKLASSEN UND STRATEGIE (YTD)

| | Global Macro (%) | Cross-Asset Trend (%) | Equity Long/ Short (%) | Commo- dity Long/ Short | Cash (%) | Total (%) |
|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------|-------------------------------|----------|-----------|
| Aktien global | -0,79 | 0,67 | | | | -0,13 |
| Global Bonds | -1,04 | -0,48 | | | | -1,53 |
| Rohstoffe | | | | 3,54 | | 3,54 |
| Credit Spreads | -0,01 | | | | | -0,01 |
| Currencies (G10) | -0,29 | -0,72 | | | | -1,01 |
| Currencies (EM) | 3,03 | 0,09 | | | | 3,12 |
| Short-Term IR | | -0,42 | | | | -0,42 |
| Volatilität | -0,08 | | | | | -0,08 |
| Low Volatility | | | 1,35 | | | 1,35 |
| Momentum | | | 1,24 | | | 1,24 |
| Quality | | | -3,83 | | | -3,83 |
| Value | | | 4,60 | | | 4,6 |
| Liquidität | | | | | 3,65 | 3,65 |
| Summe | 0,82 | -0,88 | 3,36 | 3,54 | 3,65 | 10,5 |

TOP 5 BEITRÄGE (YTD)

| | Gewinne (%) |
|----------------------|----------------|
| Commodity IC | 2,3 |
| Brazil 3M | 1,5 |
| Commodity CS Dynamic | 1,3 |
| Mexiko 3M | 1,2 |
| FTSE Taiwan | 1,0 |

SCHLECHTESTE 5 BEITRÄGE (YTD)

| | Verluste (%) |
|------------------------------|-----------------|
| South Africa FTSE/JSE Top 40 | -1,0 |
| Czech 3M | -0,8 |
| Germany DAX | -0,7 |
| Sweden Stockholm OMX | -0,7 |
| Mini Ibovespa | -0,7 |

RISIKO DER GRÖßTEN POSITIONEN
(AKTUELLER MONAT)

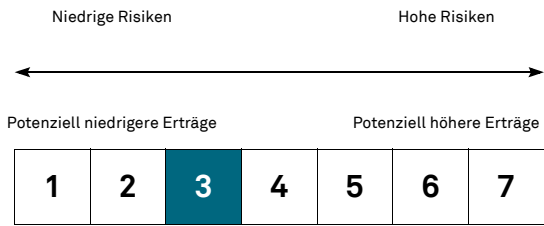
| | Ø Risikoal- lokation (%) | Art der Po- sition |
|--------------------|-----------------------------|-----------------------|
| Japan 3M | 0,89 | Short |
| Mexiko 3M | 0,84 | Long |
| Kanadisch 10Yr | 0,78 | Short |
| Schweiz 3M | 0,78 | Short |
| Decennali canadesi | 0,76 | Long |
| Korea 3M | 0,69 | Short |
| US 5 Yr | 0,68 | Short |
| Ungarn | 0,64 | Long |
| Japan TOPIX | 0,60 | Long |
| Brazil 3M | 0,56 | Long |

FONDSSTATISTIK 3 JAHRE

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Jensen Alpha | 0,45 |
| Beta | -13,64 |
| Korrelation zum Referenzindex | -0,21 |
| Information Ratio p.a. | 0,50 |
| Sharpe Ratio p. a. | 0,51 |
| Tracking Error p. a. | 8,04 |
| R² | 0,05 |
| Standardabweichung p.a. | 7,91 |
| Maximaler Drawdown | -6,55 |
| VaR (95%, unter normalen Bedingungen) | -3,05 |

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 Fondsp performance 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 30. SEPTEMBER 2025)

| | |
|---------------|---------|
| Anteilsklasse | Rendite |
| USD W (Acc.) | 2,67% |

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 (Luxembourg) S.A. (BNY MFML) oder verbundenen Fondsunternehmen für die Erbringung von Portfolioverwaltungsleistungen im Zusammenhang mit Produkt- und Dienstleistungsverträgen ernannt, die von Kunden mit BNYMIM EMEA, BNY MFML oder den Fonds von BNY Mellon abgeschlossen wurden. Die Portfolio positionen 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 ist die Unternehmensmarke von The Bank of New York Mellon Corporation und kann sich auf den Konzern insgesamt und/oder seine diversen Tochtergesellschaften allgemein beziehen.

BNY Mellon Global Funds, plc (BNYMGF) ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (ICVC) und getrennter Haftung zwischen den Teilfonds. Sie wurde als Gesellschaft mit beschränkter Haftung nach irischem Recht gegründet und von der Central Bank of Ireland als OGAW-Fonds zugelassen. Die Verwaltungsgesellschaft ist BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (BNY MFML), beaufsichtigt durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). Eingetragener Firmensitz: 2-4, Rue Eugène Ruppert, L-2453 Luxemburg. Angaben zu Anlegerrechten, einschließlich Richtlinien für den Umgang mit Beschwerden und Regressmechanismen für Anleger finden Sie unter www.bny.com/investments.

Der Manager kann die für die Vermarktung eines oder mehrerer Teilfonds von BNYMGF in einem oder mehreren EU-Mitgliedstaaten getroffenen Vereinbarungen beenden. Die Anteilinhaber werden darüber im Voraus informiert.

BNYMGF ist im Ausland zugelassen, jedoch nicht im VK. Es ist unwahrscheinlich, dass der Financial Ombudsman Service Beschwerden über BNYMGF, deren Teilfonds, deren Betreiber oder deren Verwahrstelle berücksichtigen kann. Es ist unwahrscheinlich, dass Ansprüche wegen Verlusten im Zusammenhang mit dem Betreiber und der Verwahrstelle von BNYMGF vom Entschädigungssystem abgedeckt werden. Ein potenzieller Anleger sollte erwägen, vor der Anlageentscheidung Finanzberatung in Anspruch zu nehmen, und den Prospekt von BNYMGF einsehen, der weitere Informationen enthält.

Herausgegeben in Deutschland von BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. BNY MFML, eine 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 12/11/2025