

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

INVESTMENTMANAGER



Insight ist führend in den Bereichen Risikomanagement, festverzinsliche Wertpapiere und Multi-Asset-Angelösungen.

ANLAGEZIEL

Erzielung einer Gesamtrendite aus Ertrags- und Kapitalwachstum durch die überwiegende Anlage in eine breite Palette von auf Euro lautenden Schuldtiteln und schuldtitelbezogenen Wertpapieren und damit verbundenen derivativen Finanzinstrumenten, wobei Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) berücksichtigt werden.

BENCHMARK

Die Performance des Fonds wird gegenüber dem Bloomberg Euro Aggregate Corporate TR Index (der „Referenzindex“) gemessen.

Der Fonds wird aktiv gemanagt, was bedeutet, dass die Anlagemanagementgesellschaft nach eigenem Ermessen Anlagen außerhalb des Referenzindex tätigen kann unter Berücksichtigung des Anlageziels und der Anlagepolitik. Da jedoch der Referenzindex einen beträchtlichen Teil des investierbaren Universums abdeckt, wird der Großteil der Anlagen des Teilfonds aus Komponenten des Referenzindex bestehen, und die Gewichtung im Portfolio kann ähnlich wie die Gewichtung im Referenzindex ausfallen. Die Anlagestrategie setzt der Abweichung der Portfoliobestände vom Referenzindex Grenzen und beschränkt damit auch die mögliche Outperformance des Fonds gegenüber dem Referenzindex.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN ZUM FONDS

| | |
|-------------------------|--|
| Fondsvolumen in Mio. | € 1.275,47 |
| Benchmark | Bloomberg Euro Aggregate Corporate TR Index |
| Lipper-Sektor | Bond EUR Corporates |
| Fondstyp | ICVC |
| Sitz des Fonds | Irland |
| Fondsmanager | Rob Sawbridge / Lutz Engberding / Fabien Collado |
| Basiswährung | EUR |
| Verfügbare Währungen | EUR, CHF |
| Auflegung des Fonds | 27 Mär 2021 |
| Investment Vehikel Name | BNY Mellon Global Funds, plc |
| SFDR-Kategorisierung | Article 8 |

DETAILS ZUR ANTEILSKLASSE EURO W (ACC.)

| | |
|-----------------------------|--|
| Auflegung | 27 Mär 2021 |
| Mindestanlage | € 15.000.000 |
| Max. Ausgabeaufschlag | 5,00% |
| Verwaltungsvergütung p.a. | 0,35% |
| ISIN | IE00BKWGFQ61 |
| WKN | A2QRAT |
| Zugelassen zum Vertrieb in: | AT, BE, CH, DE, DK, ES, FI, FR, GB, GG, IE, IT, JE, LU, NL, NO, PT, SE, SG |

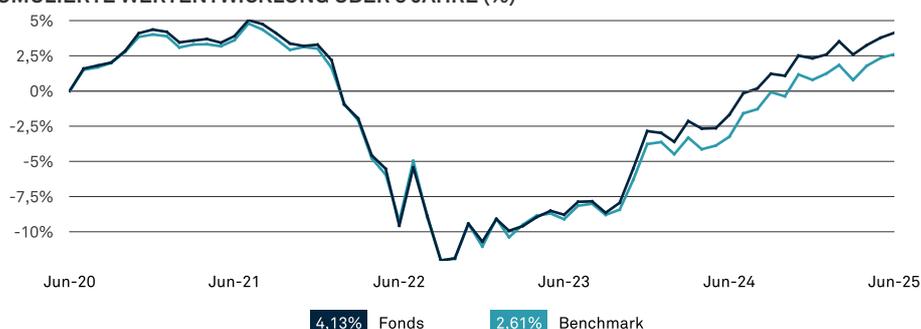
HANDEL

An jedem Geschäftstag zwischen 9.00 Uhr und 17.00 Uhr.
Bewertungszeitpunkt: 12.00 Uhr (Dubliner Zeit).
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.

HINWEISE ZUM ANLAGEZIEL UND ZUR DARSTELLUNG DER WERTENTWICKLUNG

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Maßstab für die zukünftige Wertentwicklung. Simulierte Wertentwicklungsergebnisse besitzen grundsätzlich eine lediglich begrenzte Aussagekraft. Simulierte Ergebnisse beziehen sich nicht auf tatsächliche Transaktionen/Erträge und sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Performance. Erhobene Kosten und Gebühren können erhebliche Auswirkungen auf die Performance Ihres Investments haben. Der Wert von Investments kann sinken. Deshalb besteht die Möglichkeit, dass Anleger den investierten Betrag nicht in voller Höhe zurückerhalten. Die laufenden Erträge eines Investments können schwanken und werden nicht garantiert. Die Erträge können aufgrund von Wechselkursschwankungen sowohl steigen als auch sinken, wenn Ihre Investition in einer anderen Währung als derjenigen getätigt wurde, die in der Berechnung der Wertentwicklung in der Vergangenheit verwendet wurde.

KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG ÜBER 5 JAHRE (%)



PERFORMANCE-RÜCKBLICK (%)

| | 1 Monat | 3 Monate | Seit Jahresbeginn | 1 Jahr | Annualisiert | | | Seit Auflegung | | | |
|---------------|---------|----------|-------------------|--------|--------------|---------|---------|----------------|--------|------|------|
| | | | | | 2 Jahre | 3 Jahre | 5 Jahre | | | | |
| Euro W (Acc.) | 0,33 | 1,50 | 1,76 | 5,92 | 6,84 | 4,81 | 0,81 | 25,20 | | | |
| Benchmark | 0,26 | 1,81 | 1,80 | 6,05 | 6,24 | 4,17 | 0,52 | 20,40 | | | |
| | | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 |
| Fonds | | -0,04 | 4,69 | 3,40 | -1,46 | 6,51 | 4,13 | -1,03 | -13,54 | 8,79 | 5,32 |
| Benchmark | | -0,56 | 4,73 | 2,41 | -1,25 | 6,24 | 2,77 | -0,97 | -13,65 | 8,19 | 4,73 |

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.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit basiert auf einer simulierten Erfolgsbilanz, die die Wertentwicklung der Anteilsklasse Insight Sustainable Euro Corporate Bond Fund A Acc EUR bis zum 27. März 2021 und der Anteilsklasse Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund Euro W (Acc.) danach kombiniert. Im März 2021 wurde der Insight Sustainable Euro Corporate Bond Fund zum Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund verschmolzen.

ESG-RISIKOBEWERTUNGEN VON MORNINGSTAR



Von 2443 Fonds aus der globalen Kategorie Europe Fixed Income, per 30/04/2025. Basierend auf 90,35 % AUM, ausschließlich „long“ Positionen wurden berücksichtigt. Das ESG-Risikobewertungen von Morningstar™ misst, wie gut die emittierenden Unternehmen oder Länder der Anlagen im Fondsportfolio ihre finanziell wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Risiken (ESG) im Vergleich zu anderen Fonds derselben Morningstar-Kategorie verwalten. Die Bewertungen reichen von 1 Globus (niedrig) bis 5 Globen (hoch). Höhere Bewertungen weisen darauf hin, dass die Fondsinvestitionen im Vergleich zu Vergleichsfonds ein geringeres ESG-Risiko aufweisen. Ausführliche Informationen zur Bewertungsmethodik finden Sie unter www.morningstar.com. © 2024 Morningstar. All rights reserved. The information contained herein: (1) is proprietary to Morningstar and/or its content providers; (2) may not be copied or distributed; and (3) is not warranted to be accurate, complete, or timely. Neither Morningstar nor its content providers are responsible for any damages or losses arising from any use of this information.

BONITÄTSGEWICHTUNG (%)

| | Fonds | Bench- mark |
|------------------|-------|----------------|
| AAA | 0,0 | 0,4 |
| AA | 1,5 | 7,4 |
| A | 32,1 | 41,1 |
| BBB | 56,3 | 51,1 |
| BB | 4,9 | 0,0 |
| B | 0,1 | 0,0 |
| Credit indices | -14,6 | 0,0 |
| Insight funds | 1,7 | 0,0 |
| Nicht eingestuft | 0,0 | 0,0 |
| Liquidität | 18,0 | 0,0 |

TOP 10-POSITIONEN (%)

| | Fonds |
|---|-------|
| Banco De Credito Social 7.5% 14sep2029 (callable 14sep28) | 1,2 |
| General Motors Finl Co 3.7% 14jul2031 (callable 14may31) | 1,0 |
| Rci Banque Sa 4.125% 04apr2031 (callable 04jan31) | 0,8 |
| Lseg Netherlands Bv 2.75% 20sep2027 (callable 20aug27) | 0,8 |
| Unicaja Banco Sa 7.25% 15nov2027 (callable 15nov26) | 0,7 |
| Kraft Heinz Foods Co 3.25% 15mar2033 (callable 15dec32) | 0,7 |
| Bnp Paribas 4.75% 13nov2032 (callable 13nov31) | 0,7 |
| Eurogrid Gmbh 3.279% 05sep2031 (callable 05jun31) | 0,7 |
| Jpmorgan Chase and Co 4.457% 13nov2031 (callable 13nov30) | 0,7 |
| Fidelity Natl Info Serv 1.5% 21may2027 (callable 21feb27) | 0,7 |

SEKTOR ALLOKATION (%)

| | Fonds |
|----------------------|-------|
| Financials | 44,5 |
| Industrials | 20,4 |
| Consumer | 15,4 |
| Utilities | 8,8 |
| Telecoms | 5,7 |
| Govt / Supranational | 0,1 |
| Cash & Others | 5,0 |

LAUFZEITVERTEILUNG (%)

| | Fonds | Bench- mark |
|-------------|-------|----------------|
| 0-1 Jahr | -4,4 | 0,2 |
| 1-3 Jahre | 28,9 | 31,0 |
| 3-5 Jahre | 28,9 | 27,7 |
| 5-7 Jahre | 28,1 | 19,6 |
| 7-10 Jahre | 12,2 | 15,1 |
| 10-15 Jahre | 5,0 | 4,6 |
| 15-25 Jahre | 1,4 | 1,6 |
| 25+ Jahre | -0,3 | 0,3 |

GEWICHTUNG NACH BRANCHEN (%)

| | Fonds | Bench- mark |
|----------------|-------|----------------|
| Non-Financials | 50,3 | 61,5 |
| Finanzwesen | 44,5 | 38,5 |
| Insight Funds | 1,7 | 0,0 |
| Supranationals | 0,1 | 0,0 |
| Kreditindizes | -14,6 | 0,0 |
| Liquidität | 18,0 | 0,0 |

WÄHRUNGSGEWICHTUNG (%)

| | Fonds | Bench- mark |
|-----|-------|----------------|
| EUR | 100,0 | 100,0 |
| USD | 0,0 | 0,0 |
| GBP | 0,0 | 0,0 |

FONDSSTATISTIK 3 JAHRE

| | |
|---------------------------------------|-------|
| Jensen Alpha | 0,06 |
| Beta | 0,93 |
| Korrelation zum Referenzindex | 0,99 |
| Information Ratio p.a. | 0,65 |
| Sharpe Ratio p. a. | 0,34 |
| Tracking Error p. a. | 0,94 |
| R ² | 0,97 |
| Standardabweichung p.a. | 5,31 |
| Maximaler Drawdown | -7,26 |
| VaR (95%, unter normalen Bedingungen) | -2,16 |

PORTFOLIOKENNZAHLEN

| | Fonds | Bench- mark |
|------------------------------|--------|----------------|
| Rückzahlungsrendite (%) | 3,08 | 3,05 |
| Spread to Government (bp) | 111,92 | 90,52 |
| Spread to RFR (SA) | 113,85 | 101,10 |
| Duration (Jahren) | 4,67 | 4,54 |
| Spread-duration (in Jahren) | 5,04 | 4,57 |
| Maturity (years) | 5,30 | 5,13 |
| Durchschnittlicher Kupon (%) | 3,45 | 2,75 |
| Average rating (optimistic) | A | A- |
| Average rating (pessimistic) | A- | BBB+ |
| Holdings | 356 | 3.907 |
| Emittent | 204 | 742 |

ASSET ALLOKATION - NACH LÄNDERN (%)

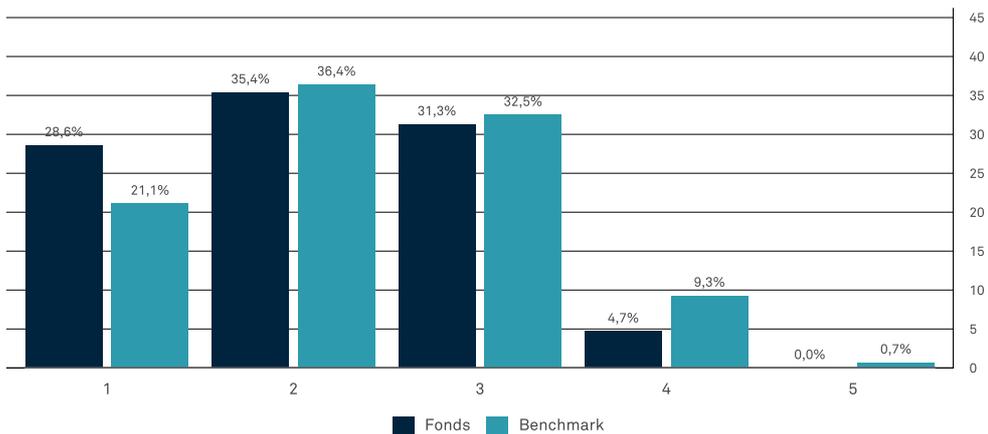
| | Fonds | Bench- mark |
|----------------|-------|----------------|
| Frankreich | 15,4 | 19,18 |
| USA | 13,8 | 21,85 |
| Großbritannien | 11,5 | 7,87 |
| Deutschland | 11,0 | 13,24 |
| Spanien | 9,0 | 5,99 |
| Niederlande | 7,2 | 4,92 |
| Italien | 4,3 | 5,84 |
| Schweiz | 3,2 | 2,25 |
| Österreich | 2,8 | 1,24 |
| Belgien | 2,5 | 2,08 |
| Portugal | 2,2 | 0,50 |
| Sonstige | 17,2 | 15,03 |

Quelle: BNY Mellon Investment Management EMEA Limited

RATINGS

Morningstar Ratings © 2025 Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. Die Ratings werden am jeweils ersten Bankarbeitstag eines Monats zusammengestellt.

GESAMTÜBERSICHT DER ESG-BEWERTUNGEN (%)^



ART DES IMPACTS^^

| | Fonds (%) | Benchmark (%) |
|------------------------------|-----------|---------------|
| Impact Bonds* | 31,7 | 16,3 |
| Green | 27,3 | 14,2 |
| Social | 3,2 | 1,4 |
| Sustainability | 1,1 | 0,7 |
| Impact Issuers* | 10,6 | 16,6 |
| Improving Issuers* | 0,0 | 0,0 |
| Nachhaltige Anlagen** | 42,3 | 32,9 |

Die Analyse beruht auf den Rahmenbedingungen der einzelnen Unternehmen, die Impact Bonds ausgeben.

* Der prozentuale Anteil der Impact Bonds und Impact-Emittenten im Fonds entspricht den Impact Investment Frameworks von Insight, der prozentuale Anteil dieser im Referenzindex entspricht ihnen nicht unbedingt. Bei den Impact Bonds handelt es sich um „Use-of-Proceeds“-Anleihen.

** Der prozentuale Anteil an nachhaltigen Anlagen im Fonds entspricht der Richtlinie für nachhaltige Investitionen, der PAI-Richtlinie und der Unternehmensführungsrichtlinie von Insight.

Der prozentuale Anteil an nachhaltigen Anlagen im Referenzindex wurde nicht im Hinblick auf diese Richtlinien geprüft.

CARBON INTENSITY ANALYSIS SCOPE 1, 2 & 3 (TONNES/USD MILLIONS SALES)^^^

| | Coverage (%) | Renormalised |
|------------------|--------------|--------------|
| Fund | 89,00 | 520 |
| Benchmark | 97,00 | 719 |

Die Erfassung von Scope 3 beruht zu 100% auf Schätzungen.

^ESG-Bewertung: Quelle: Insight. Referenzindex: Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bond Index. Bei den ESG-Bewertungen handelt es sich um einen gewichteten Durchschnitt der Prime ESG-Ratings der Wertpapiere im Portfolio. Die Prime Ratings von Insight zielen darauf ab, die wichtigsten ESG-Risiken für die finanzielle Performance eines Emittenten aufzuzeigen. Die Prime Ratings reichen von 1 (bestmögliche Bewertung) bis 5 (schlechteste Bewertung). Die aggregierte durchschnittliche ESG-Bewertung für das Portfolio ist indikativ. Es besteht keine Garantie, dass sie einen wesentlichen Einfluss auf die Anlageentscheidungen hat. Wertpapiere ohne ein Prime ESG-Rating sind von den Responsible Horizons-Portfolios ausgeschlossen.

^^Impact Bonds: Quelle: Insight. Referenzindex: Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bond Index. Die Anleihekategorien beruhen auf den Prinzipien der International Capital Market Association. Zur Klarstellung: Nach dieser Kategorisierung handelt es sich bei Sustainability-Linked Bonds (SLB) nicht um nachhaltige Anleihen (Sustainability Bonds) oder Impact Bonds. Diese Zuschreibungen stellen – mit Ausnahme der in den Anlagebedingungen festgelegten Allokationen – keine Ziel-Fondsallokationen dar. Es kann nicht davon ausgegangen werden, dass über die genannten Kriterien hinaus weitere ESG-Kriterien auf dieses Portfolio angewandt werden.

^^^CO2-Analyse: Quelle: Insight, MSCI, JP Morgan und Bloomberg. Referenzindex: Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bond Index. Die Erfassung von Scope-1- und Scope-2-Emissionen zusammen kann die Erfassung der einzelnen Teile übersteigen. Bei den Erfassungen der Scope 3-Emissionen handelt es sich um Schätzungen. Alle Schätzungen werden von MSCI bereitgestellt. Die normalisierte Zahl wird berechnet, indem Datenlücken geschlossen werden: Wenn Insight keine Daten über Emissionen vorliegen, wird der Durchschnittswert des Fonds verwendet. Diese Zuschreibungen stellen keine über die in den Anlagebedingungen festgelegten Allokationen hinausgehenden Ziel-Fondsallokationen dar.

CARBON METHODOLOGY

Weighted average carbon intensity

$$\sum_i \left(\frac{\text{current value of investment}_i}{\text{current portfolio value}} \times \frac{\text{issuer's GHG emissions}_i}{\text{issuer's \$M revenue}_i} \right)$$

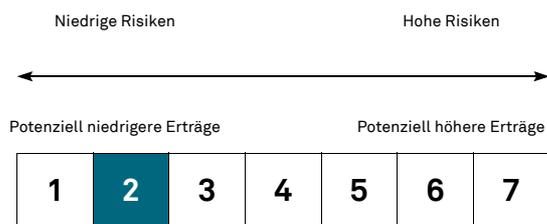
Carbon footprint

$$\frac{\sum_i \left(\frac{\text{book value of investment}_i}{\text{issuer's enterprise value (EVIC)}_i} \times \text{issuer's GHG emissions}_i \right)}{\text{current portfolio value (\$M)}}$$

GHG emissions

$$\sum_i \left(\frac{\text{book value of investment}_i}{\text{issuer's enterprise value (EVIC)}_i} \times \text{issuer's GHG emissions}_i \right)$$

ZUSAMMENFASSENDE RISIKOINDIKATOR (SRI) - EURO 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 |
|---------------|---------|
| Euro W (Acc.) | 2,96% |

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 Anteilhaber 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