

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. \$ 36,03
 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

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/PRIPs-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.

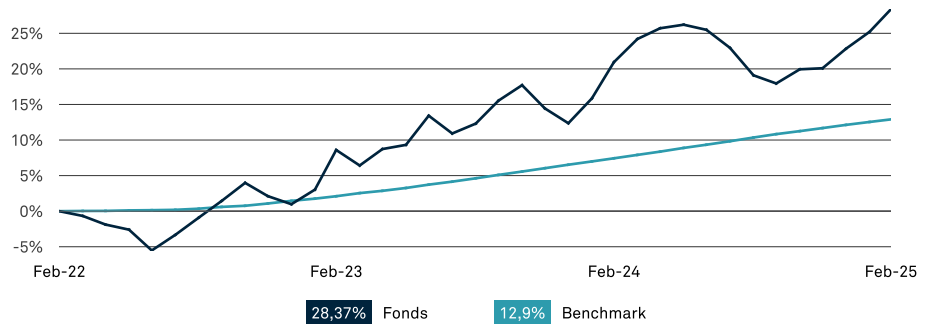
Flexible Implementierung: Long- oder Short-, marktneutrale oder direktionale sowie Long-Short-Spread-Positionen.

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 (%)

| | 1 Jahr | | | | Annualisiert | | | Seit Auflegung |
|------------------------|---------|----------|-------------------|--------|--------------|---------|---------|----------------|
| | 1 Monat | 3 Monate | Seit Jahresbeginn | 1 Jahr | 2 Jahre | 3 Jahre | 5 Jahre | |
| USD W (Acc.) | 2,52 | 6,89 | 4,50 | 6,14 | 8,71 | 8,67 | - | 18,70 |
| Benchmark | 0,32 | 1,09 | 0,69 | 5,09 | 5,15 | 4,12 | 2,55 | 12,92 |
| Euro W (Acc.) (hedged) | 2,40 | 6,44 | 4,24 | 4,56 | 6,78 | 6,59 | - | 12,51 |
| Benchmark | 0,32 | 1,09 | 0,69 | 5,09 | 4,97 | 3,98 | 2,46 | 12,92 |

| | 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 Fondspersformance 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 (%) | Total (%) |
|-------------------|------------------|-----------------------|-----------------------|-----------|
| Aktien global | 0,76 | 0,73 | | 1,50 |
| Anleihen global | 0,22 | 0,30 | | 0,52 |
| Rohstoffe | 0,54 | | | 0,54 |
| Währungen | 0,50 | 0,34 | | 0,84 |
| Währungen | 1,01 | 0,01 | | 1,01 |
| Short-Term IR | | 0,07 | | 0,07 |
| Securities Aktien | | | 3,66 | 3,66 |
| Summe | 3,03 | 1,44 | 3,66 | 8,13 |
| Prozentsatz | 37,23 | 17,73 | 45,04 | 100,00 |

ERTRAGSATTRIBUTION NACH ASSETKLASSEN UND STRATEGIE (YTD)

| | Global Macro (%) | Cross-Asset Trend (%) | Equity Long/Short (%) | Cash (%) | Total (%) |
|-----------------|------------------|-----------------------|-----------------------|----------|-----------|
| Aktien global | 0,19 | 0,57 | | | 0,76 |
| Anleihen global | -1,37 | 0,09 | | | -1,29 |
| Rohstoffe | 0,04 | | | | 0,04 |
| Credit Spreads | 0,03 | 0,01 | | | 0,04 |
| Währungen | -0,12 | -0,20 | | | -0,32 |
| Währungen | 0,00 | 0,05 | | | 0,05 |
| Short-Term IR | -0,02 | -0,08 | | | -0,1 |
| Volatilität | -0,04 | | | | -0,04 |
| Low Volatility | | | 3,39 | | 3,39 |
| Momentum | | | 0,48 | | 0,48 |
| Quality | | | -0,71 | | -0,71 |
| Value | | | 1,60 | | 1,6 |
| Liquidität | | | | 0,71 | 0,71 |
| Summe | -1,30 | 0,44 | 4,76 | 0,71 | 4,6 |

TOP 5 BEITRÄGE (YTD)

| | Gewinne (%) |
|---------------------------|-------------|
| EURO Stoxx | 0,4 |
| India IFSC NIFTY 50 Index | 0,4 |
| MSCI Singapore | 0,3 |
| EURO Stoxx | 0,3 |
| Brazil 3M | 0,2 |

SCHLECHTESTE 5 BEITRÄGE (YTD)

| | Verluste (%) |
|-------------------|--------------|
| Japan 10Yr (JGB) | -0,5 |
| Japan 3M | -0,4 |
| Germany DAX | -0,3 |
| Australia ASX SPI | -0,3 |
| Spain IBEX 35 | -0,3 |

Ø RISIKO DER GRÖßTEN POSITIONEN (AKTUELLER MONAT)

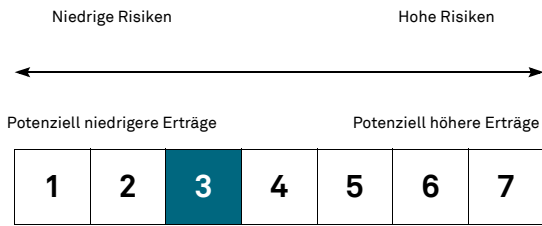
| | Ø Risikoallokation (%) | Art der Position |
|------------------------------|------------------------|------------------|
| Schweiz 3M | 1,13 | Short |
| Kanadisch 10Yr | 1,02 | Short |
| Brazil 3M | 0,90 | Long |
| Chile 3M | 0,47 | Short |
| Canada 3M | 0,45 | Short |
| France CAC 40 | 0,43 | Short |
| South Africa FTSE/JSE Top 40 | 0,35 | Short |
| Colombian Peso 3M NDF | 0,28 | Long |
| Australien | 0,19 | Long |
| US IG CDS | 0,11 | Short |

FONDSSTATISTIK 3 JAHRE

| | |
|---------------------------------------|-------|
| Jensen Alpha | 0,29 |
| Beta | -7,94 |
| Korrelation zum Referenzindex | -0,18 |
| Information Ratio p.a. | 0,55 |
| Sharpe Ratio p. a. | 0,54 |
| Tracking Error p. a. | 7,74 |
| R ² | 0,03 |
| Standardabweichung p.a. | 7,69 |
| Maximaler Drawdown | -6,55 |
| VaR (95%, unter normalen Bedingungen) | -2,98 |

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.JANUAR 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.

Die Höhe der laufenden Kosten finden Sie in der EMT-Datei, die laufenden Gebühren im aktuellsten KIID.

WICHTIGE KUNDENINFORMATION

Ausschließlich für professionelle Kunden. Die Investment Manager werden von BNY Mellon Investment Management EMEA Limited (BNYMIM EMEA), BNY Mellon Fund Managers Limited (BNYMFM), 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 www.bnymellonim.com. 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 www.bnymellonim.com 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).

MIS0071-300625

Herausgegeben per 13/03/2025