

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

# BNY Mellon Dynamic Factor Premia VIO 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

Mittels eines Multi-Asset-Ansatzes bei der Portfoliostrukturierung und Wertpapierauswahl eine Gesamtrendite erwirtschaften, die über einen Anlagehorizont von 3 bis 5 Jahren über dem ICE BofA US 3-Month Treasury Bill Index (der „Cash-Referenzwert“) mit einer Zielvolatilität von 10 % liegt.

## 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. \$ 33,00  
 Benchmark FTSE 3 Month US T Bill Index  
 Lipper-Sektor Mixed Asset USD Flexible - Global  
 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

Kosten, die beim Kauf, Verkauf, Halten oder der Konvertierung eines Investments entstehen, werden die Erträge beeinflussen. Kosten können höher oder niedriger ausfallen, wenn Währungen bzw. Wechselkurse schwanken. Für weitere Details lesen Sie bitte das Basisinformationsblatt (KID-Dokument).

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. 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.

## \_D\_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.

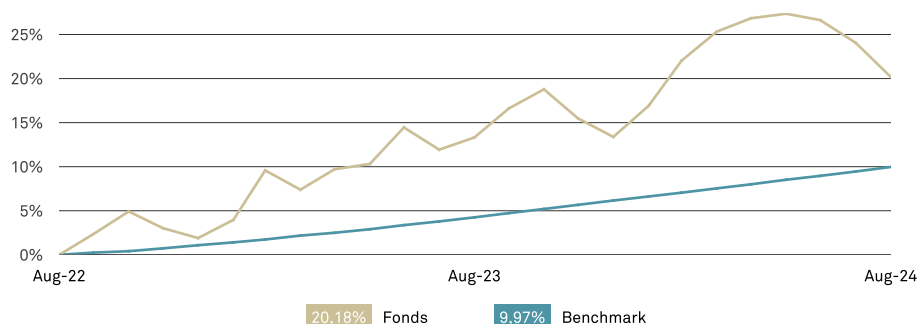
**Flexible Implementierung:** Long- oder Short-, marktneutrale oder direktionale sowie Long-Short-Spread-Positionen.

**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 Maßstab für die zukünftige Wertentwicklung. 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. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt, Informationsdokument, und das KID/KIID, bevor Sie eine Anlageentscheidung treffen. Diese Dokumente sind in auf [www.bnymellonim.com](http://www.bnymellonim.com) in englischer Sprache und in einer Amtssprache der Länder verfügbar, in denen der Fonds zum öffentlichen Vertrieb registriert ist. Die Erträge können aufgrund von Wechselkursschwankungen sowohl steigen als auch sinken. Eine vollständige Übersicht der Risiken dieses Fonds finden Sie im Verkaufsprospekt oder in den weiteren Produktunterlagen.

## KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG ÜBER 2 JAHRE (%)



## PERFORMANCE-RÜCKBLICK (%)

	1 Monat	3 Monate	Seit Jahresbeginn	1 Jahr	Annualisiert			Seit Auflegung
					2 Jahre	3 Jahre	5 Jahre	
USD W (Acc.)	-3,14	-5,64	6,00	6,05	9,61	-	-	10,13
USD C (Acc.)	-3,17	-5,68	5,85	5,83	9,38	-	-	9,50
Benchmark	0,48	1,34	3,58	5,48	4,86	3,34	2,26	10,37
Sektor	1,51	3,75	7,11	11,78	7,95	0,39	3,82	1,20
Euro W (Acc.) (hedged)	-3,26	-5,97	4,97	4,58	7,49	-	-	5,21
Benchmark	0,48	1,34	3,58	5,48	4,69	3,23	2,19	10,37
Anzahl im Sektor	188	186	180	170	152	-	-	144
Quartil USD W (Acc.)	-	-	-	4	2	-	-	1

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
Fonds	-	-	-	-	-	-	-	-	-5,68	11,27
Benchmark	0,03	0,05	0,33	0,85	1,88	2,28	0,67	0,05	1,46	5,01

Quelle: Lipper, 31. August 2024. Die Wertentwicklung des Fonds für die Anteilsklasse USD W (Acc.) wird berechnet als Gesamtertrag basierend auf dem Nettoinventarwert, einschließlich Gebühren und reinvestierter laufender Erträge nach Abzug von Steuern. Dabei werden jedoch keine Ausgabeaufschläge berücksichtigt. Alle Zahlen verstehen sich in der Währung der entsprechenden Anteilsklasse. Der Ausgabeaufschlag, der bis zu 5% betragen kann, kann beträchtliche Auswirkungen auf die Wertentwicklung Ihres Investments haben. Wertentwicklungszahlen, die den Ausgabeaufschlag berücksichtigen, werden auf Anfrage zur Verfügung gestellt. **Die Erträge können aufgrund von Wechselkursschwankungen sowohl steigen als auch sinken.**

**RISIKOALLOKATION NACH ASSETKLASSEN UND STRATEGIE (AKTUELLER MONAT)**

	Global Macro (%)	Cross-Asset Trend (%)	Equity Long/Short (%)	Total (%)
Aktien global	0,42	1,00		1,42
Anleihen global	0,75	1,27		2,02
Rohstoffe	0,26			0,26
Credit Spreads	0,07			0,07
Währungen	0,36	0,80		1,16
Währungen	0,61	0,19		0,81
Short-Term IR	0,23	0,11		0,34
Volatilität	0,22			0,22
Securities Aktien			2,54	2,54
Summe	2,93	3,37	2,54	8,84
Prozentsatz	33,14	38,12	28,75	100,00

**ERTRAGSATTRIBUTION NACH ASSETKLASSEN UND STRATEGIE (YTD)**

	Global Macro (%)	Cross-Asset Trend (%)	Equity Long/Short (%)	Cash (%)	Total (%)
Aktien global	0,66	-0,39			0,27
Anleihen global	0,34	-0,52			-0,18
Rohstoffe	0,25				0,25
Credit Spreads	0,02				0,02
Währungen	0,44	-0,63			-0,19
Währungen	-0,62	-0,14			-0,76
Short-Term IR	0,23	-0,15			0,08
Volatilität	-0,57				-0,57
Securities Aktien			3,88		3,88
Liquidität				3,61	3,61
Summe	0,75	-1,83	3,88	3,61	6,4

**TOP 5 BEITRÄGE (YTD)**

	Gewinne (%)
Euro 5 Yr (Bobl)	1,2
MSCI Singapore	0,7
Italy FTSE MIB	0,5
Commodity Spread	0,5
Japan TOPIX	0,4

**SCHLECHTESTE 5 BEITRÄGE (YTD)**

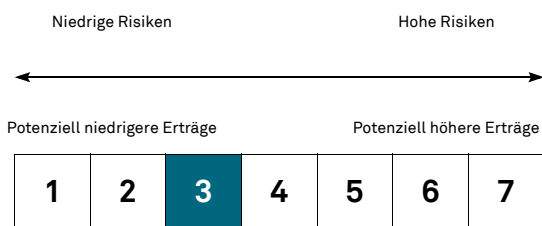
	Verluste (%)
Mexiko 3M	-1,0
Short Vol	-0,8
VIX	-0,7
Malaysia 3M	-0,5
Japan 10Yr (JGB)	-0,4

**Ø RISIKO DER GRÖßTEN POSITIONEN (AKTUELLER MONAT)**

	Ø Risikoallokation (%)	Art der Position
Commodity Spread	1,84	Long/Short
Euro 5 Yr (Bobl)	1,53	Short
Japan 10Yr (JGB)	1,19	Long
US 5 Yr	1,11	Short
Japan 3M	1,00	Short
Mexiko 3M	0,99	Long
Schweiz 3M	0,84	Short
Australien	0,80	Long
Kanadisch 10Yr	0,80	Short
Ungarn	0,79	Long

Quelle: BNY Mellon Investment Management EMEA Limited

**RISIKO- UND ERTRAGSPROFIL - USD W (ACC.)**



Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubehalten.

Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse mittelniedrige Risikoklasse eingestuft, wobei dies einem 3 entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelniedriges eingestuft. Ungünstige Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich wirken sich auf die Fähigkeit von BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. aus, Sie auszuzahlen.

**AUSSCHÜTTUNGSPROGNOSE (STAND 31. JULI 2024)**

Anteilsklasse	Rendite
USD W (Acc.)	2,77%

Ausschüttungsrendite : Unter der Ausschüttungsrendite versteht man die für die nächsten 12 Monate erwarteten Ausschüttungen eines Fonds in Prozent des aktuellen Anteilspreises des Fonds. Bei der Ausschüttungsrendite handelt es sich um eine Momentaufnahme des Portfolios zum jeweils angegebenen Zeitpunkt. Diese Kennzahl berücksichtigt keine Ausgabeaufschläge. Außerdem besteht die Möglichkeit , dass Anleger die Ausschüttungen versteuern müssen.

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 (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 [www.bnymellonim.com](http://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](http://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 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).

MIS0071-311224

Herausgegeben per 11/09/2024