

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

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

INVESTMENTMANAGER



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

Der Fonds wurde per 1. September 2021 einer anderen Investmentfirma übertragen. Vor diesem Datum wurde er von Mellon Investments Corporation, LLC verwaltet.

BENCHMARK

Die Wertentwicklung des Fonds wird gegenüber dem Bloomberg US HY Fallen Angel 3% Cap TR Index (der „Referenzindex“) gemessen. Die Anlagemanagementgesellschaft verwendet den Referenzindex zum Aufbau des Anlageuniversums. Der Fonds wird aktiv verwaltet und verfolgt nicht das Ziel, sämtliche Bestandteile des Referenzindex nachzubilden. Die Anlagemanagementgesellschaft verfügt über einen eingeschränkten Ermessensspielraum, um außerhalb des Referenzindex Investitionen zu tätigen, wenn das entsprechende Wertpapier die Voraussetzungen des Referenzindex erfüllt und voraussichtlich in den Referenzindex aufgenommen wird. Der Großteil der Anlagen des Fonds wird aus Komponenten des Referenzindex bestehen, daher wird der Fonds vorbehaltlich von Anlagebeschränkungen in Bezug auf seine Duration, das Währungs- und Sektorengagement sowie des Bonitätsprofils Ähnlichkeiten aufweisen. Allerdings beabsichtigt die Anlagemanagementgesellschaft nicht, das Fälligkeitsprofil des Referenzindex nachzubilden. Die Anlagestrategie weist mittel- bis langfristig eine dem Referenzindex ähnliche Volatilität auf.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN ZUM FONDS

Fondsvolumen in Mio. \$ 614,59
 Benchmark Bloomberg US HY Fallen Angel 3% Cap TR Index
 Lipper-Sektor Lipper Global - Bond Global High Yield USD
 Fondstyp ICVC
 Sitz des Fonds Irland
 Fondsmanager Teamansatz
 Basiswährung USD
 Verfügbare Währungen USD, EUR, GBP, CHF, JPY, HKD
 Auflegung des Fonds 21 Sep 2020
 SFDR-Kategorisierung Article 8

DETAILS ZUR ANTEILSKLASSE USD W (ACC.)

Auflegung 21 Sep 2020
 Mindesteinlage \$ 15.000,000
 Max. Ausgabeaufschlag 5,00%
 Verwaltungsvergütung p.a. 0,30%
 ISIN IE00BM94ZR83
 WKN A2QDLC

Zugelassen zum Vertrieb in: AT, BE, CH, CL, DE, DK, ES, FI, FR, GB, GG, IE, IT, JE, KR, LU, NL, NO, PE, PT, SE, SG
 Anleger sollten sich auf das KIID/PRIIPs-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.

HANDEL

An jedem Geschäftstag zwischen 9.00 Uhr und 17.00 Uhr.
 Bewertungszeitpunkt: 22.00 Uhr (Dubliner 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.

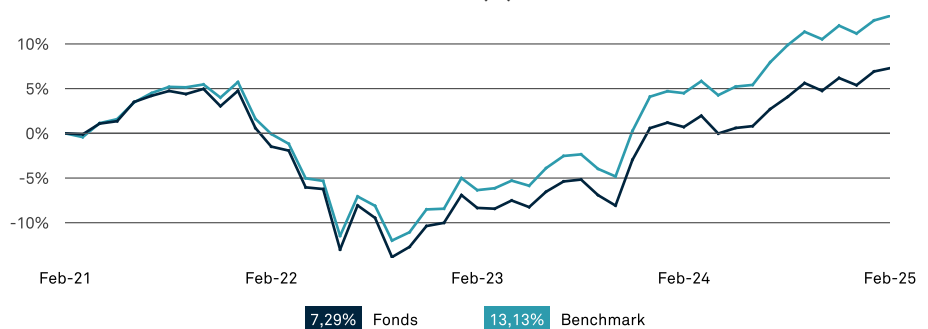
ANLAGEZIEL

Mittel- bis langfristig eine Rendite zu erwirtschaften, die vor Gebühren und Aufwendungen über der Rendite des (nachstehend beschriebenen) Referenzwerts liegt, wobei Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) berücksichtigt werden.

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 4 JAHRE (%)



PERFORMANCE-RÜCKBLICK (%)

| | Annualisiert | | | | | | | | | |
|--------------|--------------|----------|-------------------|--------|---------|---------|---------|----------------|-------|------|
| | 1 Monat | 3 Monate | Seit Jahresbeginn | 1 Jahr | 2 Jahre | 3 Jahre | 5 Jahre | Seit Auflegung | | |
| USD W (Acc.) | 0,34 | 1,03 | 1,80 | 6,53 | 8,18 | 2,88 | - | 17,15 | | |
| USD C (Acc.) | 0,32 | 0,99 | 1,77 | 6,35 | 8,01 | 2,72 | - | 16,37 | | |
| USD A (Acc.) | 0,31 | 0,95 | 1,74 | 6,20 | 7,85 | 2,57 | - | 15,59 | | |
| Benchmark | 0,45 | 0,97 | 1,77 | 8,27 | 9,90 | 4,22 | 6,01 | 24,37 | | |
| | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 |
| Fonds | - | - | - | - | - | - | 5,35 | -14,10 | 11,76 | 4,79 |
| Benchmark | -2,37 | 26,74 | 9,86 | -4,11 | 16,86 | 16,64 | 6,57 | -13,40 | 13,68 | 6,79 |

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.

MORNINGSTAR

SUSTAINABILITY RATINGS



Von 3819 Fonds aus der globalen Kategorie US Fixed Income, per 31/12/2024. Basierend auf 81,51 % AUM, ausschließlich „long“ Positionen wurden berücksichtigt. Das Morningstar Sustainability Rating™ 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 (%)

| Jahre | Fonds | Bench- mark |
|------------|-------|----------------|
| IG | 0,0 | 0,0 |
| BB | 82,5 | 82,4 |
| B | 7,2 | 7,5 |
| CCC | 7,6 | 8,4 |
| CC | 2,1 | 1,8 |
| Liquidität | 0,5 | 0,0 |

EMITTENT (%)

| | Fonds |
|------------------------------|-------|
| VF Corp | 3,88 |
| Celanese US Holdings LLC | 3,53 |
| Service Properties Trust | 3,39 |
| Hudson Pacific Properties LP | 3,16 |
| Vodafone Group PLC | 3,05 |
| Alcoa Nederland Holding BV | 2,94 |
| Walgreens Boots Alliance Inc | 2,94 |
| Nordstrom Inc | 2,92 |
| Telecom Italia Capital SA | 2,89 |
| Buckeye Partners LP | 2,83 |

SEKTOR ALLOKATION (%)

| | Fonds | Bench- mark |
|---------------------------|-------|----------------|
| Zyklische Konsumgüter | 28,7 | 27,1 |
| Kommunikation | 12,5 | 12,4 |
| REITS | 11,9 | 9,0 |
| Basisindustrie | 10,7 | 9,9 |
| Antizyklische Konsumgüter | 7,0 | 7,2 |
| Energie | 6,9 | 8,2 |
| Sonstige | 22,2 | 26,3 |

FONDSSTATISTIK 3 JAHRE

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Jensen Alpha | -0,11 |
| Beta | 1,06 |
| Korrelation zum Referenzindex | 0,99 |
| Information Ratio p.a. | -1,21 |
| Sharpe Ratio p. a. | -0,15 |
| Tracking Error p. a. | 1,07 |
| R ² | 0,99 |
| Standardabweichung p.a. | 8,63 |
| Maximaler Drawdown | -12,54 |
| VaR (95%, unter normalen Bedingungen) | -3,89 |

LAUFZEITVERTEILUNG (%)

| Jahre | Fonds | Bench- mark |
|---------------|-------|----------------|
| 0-1 Jahre | 0,5 | 0,0 |
| 1-3 Jahre | 31,0 | 29,9 |
| 3-5 Jahre | 24,2 | 25,2 |
| 5-7 Jahre | 13,0 | 11,5 |
| 7-10 Jahre | 10,8 | 12,3 |
| 10 - 15 Jahre | 10,2 | 10,3 |
| 15-25 Jahre | 9,7 | 10,4 |
| > 25 Jahre | 0,5 | 0,4 |

PORTFOLIOKENNZAHLEN

| | Fonds | Bench- mark |
|-------------------------------|--------|----------------|
| Yield to Worst (%) | 6,93 | 6,88 |
| Rückzahlungsrendite (%) | 7,11 | 6,89 |
| Laufender Ertrag (%) | 5,91 | 5,99 |
| Effective duration yrs | 4,64 | 4,64 |
| Modified duration yrs | 4,64 | 4,64 |
| Durchschnittlicher Kupon (%) | 5,49 | 5,58 |
| Average life / maturity | 6,62 | 6,65 |
| Durchschnittl. Rating | BB | BB |
| Konvexität | 0,37 | 0,36 |
| Spread to Government (bp) | 285,79 | 270,39 |
| Number of holdings | 167 | 164 |
| Anzahl der Emittenten | 73 | 76 |
| Spread to swaps (bp) | 268,21 | 254,97 |
| Option Adjusted Spread | 285,74 | 270,39 |
| Effective spread duration yrs | 4,69 | 4,66 |
| Maturity yrs | 6,69 | 6,72 |
| Beta | 1,01 | |

WÄHRUNGSGEWICHTUNG (%)

| | Fonds | Bench- mark |
|-----|-------|----------------|
| USD | 100,0 | 100,00 |
| EUR | 0,0 | 0,00 |

DURATIONSVERTEILUNG (%)

| Jahre | Fonds | Bench- mark |
|---------------|-------|----------------|
| 0-1 Jahre | 3,5 | 3,7 |
| 1-3 Jahre | 32,5 | 31,4 |
| 3-5 Jahre | 29,8 | 29,0 |
| 5-7 Jahre | 14,5 | 14,9 |
| 7-10 Jahre | 12,3 | 13,3 |
| 10 - 15 Jahre | 7,4 | 7,7 |
| > 15 Jahre | 0,0 | 0,0 |

ANLEIHEPORTFOLIOSTRUKTUR NACH REGIONEN (%)

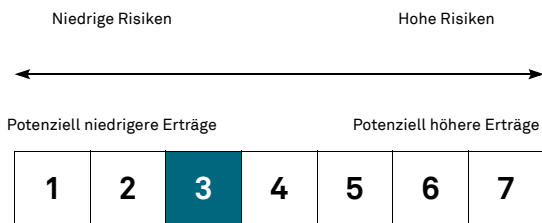
| | Fonds | Bench- mark |
|----------------|-------|----------------|
| USA | 82,8 | 84,1 |
| Italien | 5,7 | 6,0 |
| Kanada | 5,0 | 4,2 |
| Großbritannien | 3,0 | 3,0 |
| Japan | 1,6 | 1,6 |
| Sonstige | 1,9 | 1,1 |

HOLDINGS (%)

| | Fonds |
|--|-------|
| Vodafone Group Plc 7% 04apr2079 (callable 04jan29) | 3,05 |
| Rogers Communications In 5.25% 15mar2082 (callable 15mar27) 144a | 2,26 |
| Vf Corp 2.95% 23apr2030 (callable 23jan30) | 1,74 |
| Perrigo Finance Unlimite 4.9% 15jun2030 (callable 15mar30) | 1,71 |
| Aptiv Swiss Holdings Ltd 6.875% 15dec2054 (callable 15sep29) | 1,69 |
| Unicredit Spa 7.296% 02apr2034 (callable 02apr29) 144a | 1,61 |
| Dresdner Fndg Trust I 8.151% 30jun2031 (callable 30jun29) 144a | 1,56 |
| Resorts World/rwlv Cap 4.625% 16apr2029 (callable 16jan29) Regs | 1,45 |
| Vf Corp 2.8% 23apr2027 (callable 23feb27) | 1,30 |
| Embarq Corp 7.995% 01jun2036 | 1,26 |

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 Fondspemformance 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.]

TABELLE DER ANTEILSKLASSEN

| | ISIN | WKN | Auflegung | Mindesters- anlage | Verwaltungsverg. p.a. |
|--------------|--------------|--------|-------------|-----------------------|--------------------------|
| USD A (Acc.) | IE00BM94ZD48 | A2QDLA | 21 Sep 2020 | \$ 5.000 | 0,60% |
| USD C (Acc.) | IE00BM94ZM39 | A2QDLB | 21 Sep 2020 | \$ 5.000.000 | 0,45% |

AUSSCHÜTTUNGSPROGNOSE (STAND 31.JANUAR 2025)

| Anteilsklasse | Rendite |
|---------------|---------|
| USD W (Acc.) | 5,67% |
| USD A (Acc.) | 5,67% |
| USD C (Acc.) | 5,67% |

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.

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. 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 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).

MIS0071-300625

Herausgegeben per 13/03/2025